

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD011	1,131.50	▲0.3	4.6	795,146
USD012	1,131.90	▲1.0	4.2	6,064
USD/KRW	1,131.40	▲0.8	4.7	
USD/CNY	6.7049	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.920	▲0.5150	UST2Y	0.1466
EUR/USD	1.1674	▼0.0072	UST10Y	0.8230
USD/JPY	104.61	▲0.2900	UST30Y	1.6019
GBP/USD	1.2930	▼0.0053	WTI	36.11

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(10/29)

- 17:55 독일 10월 실업자 변동(결과:-35.0k, 이전:-10.0k)
 19:00 유로존 10월 소비자기대지수(F)(결과:15.5, 잠정:15.5)
 21:30 미국 신규 실업수당 청구건수(결과:751k, 이전:791k)
 21:30 미국 3분기 GDP 연간화 QoQ(결과:33.1%, 이전:-31.4%)
 21:30 미국 3분기 개인소비(결과:40.7%, 이전:-33.2%)
 21:45 유럽 ECB 통화정책회의(예상:기준금리 동결)

美 지표 서프라이즈와 완화적 ECB

금일 달러/원 예상 : 1,129.00~1,136.00

NDF 최종호가 : 1,132.20/1,132.60(+0.80)

야간달러선물 종가 : 1,131.50원 | 고가:1,134.80원 | 저가:1,131.50원

전일 국내 동향

달러/원은 유럽 봉쇄 우려에 따른 안전자산 선호를 반영하여 전일대비 3.9원 상승한 1,134.5원에 개장. 위험회피 기조 지속에 상승세를 이어가며 장 초반 1,135.8원까지 고점을 높임. 다만 네고출회와 위안화 강세에 연동한 역외매도 세에 상승폭을 반납하며 전일대비 0.8원 상승한 1,131.4원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 ECB 통화정책회의, 유럽 주요국 봉쇄 여파에 따른 유로화 약세와 예상보다 호조를 보인 미국 경기지표의 영향에 강세.

유럽 주요국의 전면 재봉쇄에 따른 경기회복 둔화 우려 지속에 유로화가 약세를 보이며 달러 강세에 영향. ECB가 정책금리를 동결하며 완화적 통화정책 기조를 유지할 것이라 밝힌 점도 유로화 약세에 일조. ECB는 이날 통화정책회의에서 내년 6월까지 팬데믹긴급매입 프로그램을 유지하고 물가상승률이 목표치인 2%에 충분히 근접할때까지 금리를 낮은 수준으로 유지한다고 발표.

이날 발표된 미국 경기 지표는 전반적으로 호조를 보이며 달러화에 상승압력을 가중. 미 상무부는 연율로 표시한 미국 3분기 GDP 성장을 속보치가 33.1%라 발표. 이는 시장 예상(32.0%)을 상회하는 수치. 개인소비는 전기대비 40.7%증가하며 이전값(-33.2%)과 예상치(38.9%)를 상회. 고용지표 또한 우려보다 양호했는데, 주간 신규실업수당 청구자수는 전주대비 75.1만명 증가하며 예상치(77만)와 전주 발표치(79.1만)를 하회.

금일 전망

금일 달러/원은 미 지표 호조와 유로화 하락이 촉발한 글로벌 달러화 반등을 쫓아 상승 압력이 우위를 보일 것으로 전망.

전일 급락한 유로화의 경우 ECB가 12월에 추가 정책 도입을 시사한 영향에 낙폭을 확대. 이는 유로화 하락 모멘텀과 이에 따른 위험통화의 약세에 영향줄 수 있음. 또한 미 대선을 앞둔 불확실성과 글로벌 주요국에서의 봉쇄 조치 강화 등에 안전자산 선호가 회복되고 있는 점도 금일 달러/원의 상승을 지지 가능.

다만 최근 월말에 따른 네고물량 출회가 달러/원의 상승폭을 조절하고 있는 점은 금일 환율의 상단을 제한 가능한 요인. 또한 위안화 강세를 추종하는 역외매도물량이 지속 유입되고 있는 점도 상단을 무겁게 만들 수 있음. 이에 금일 환율은 글로벌 달러 강세 지속에 상승세가 우위를 보일 것으로 예상하나 네고, 역외매도물량 유입이 그 폭을 제한할 것으로 예상.

금 일(10/30)

- 16:00 유럽 3분기 GDP성장을 QoQ(예상:9.6%, 이전:-11.8%)
 21:30 미국 9월 개인소득 MoM(예상:0.4%, 이전:-2.7%)
 21:30 미국 9월 개인소비지수 MoM(예상:1.0%, 이전:1.0%)
 22:45 미국 10월 시카고 PMI(예상:58.0, 이전:62.4)
 23:00 미국 10월 미시간대 소비자기대(F)(예상:81.2, 잠정:81.2)

익 일(11/02)

- 10:45 중국 10월 차이신 제조업 PMI(예상:52.8, 이전:53.0)
 17:55 독일 10월 마켓 제조업 PMI(F)(예상:--, 잠정:58.0)
 18:00 유로존 10월 마켓 제조업 PMI(F)(예상:--, 잠정:54.4)
 22:45 미국 10월 마켓 제조업 PMI(F)(예상:--, 잠정:53.3)
 00:00 미국 10월 ISM 제조업지수(예상:55.6, 이전:55.4)
 00:00 미국 10월 ISM 구매물가지수(예상:61.0, 이전:62.8)

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD011	1,131.50	0.30	1,134.70	1,135.70	1,131.10	4.60	292,604	48,789	795,146	-4,238
USD012	1,131.90	1.00	1,135.10	1,135.70	1,131.50	4.20	2,380	432	6,064	-358
USD SPOT	1,131.40	0.80	1,134.50	1,135.80	1,131.10	4.70	7,679	697	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	78,988	68,053	10,935	39,572	-34,664
은행	3,623	2,310	1,313	21,321	35,138
투신	3,436	781	2,655	4,625	-7,395
보험	1,015	166	849	588	1,907
기타법인	6,011	5,199	812	3,709	21,643
개인	30,551	24,486	6,065	-1,377	13,570
외국인	171,731	194,260	-22,529	-68,368	-30,119

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,326.67	-18.59
국고채3Y	0.927	0.013
국고채10Y	1.527	0.030

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	25.599	0.043

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-5,378	-5,247	4,635
KOSDAQ	-817	3,259	2,091
국고채	-377	-750	8,093
통안채	0	1,076	27,416

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14913	0.00138
Call	0.480	0.150	3M	0.21438	0.00000
CD	0.630	0.000	6M	0.24288	-0.00125
통안1년	0.702	0.004	12M	0.33100	0.00337

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	26,659.11	139.16	0.52	-6.01
S&P	3,310.11	39.08	1.19	-4.15
나스닥	11,185.59	180.72	1.64	-2.78
FTSE 100	5,581.75	-1.05	-0.02	-3.52
DAX 30	11,598.07	37.56	0.32	-7.53
Nikkei 225	23,331.94	-86.57	-0.37	-0.61
Shanghai	3,272.73	3.49	0.11	-1.20
항셍 H	9,955.46	-7.90	-0.08	-1.21
미국채 2년	0.1466	0.0000	0.00	-4.37
미국채 10년	0.8230	0.0520	6.74	-3.88
WTI	36.11	-1.28	-3.42	-11.15
Gold	1,867.80	-13.29	-0.71	-1.73

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.20	0.00
3M	0.05	0.00
6M	-0.40	-0.10
12M	-1.30	-0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.135	-0.015
2Y	0.120	-0.010
3Y	0.160	-0.010
4Y	0.185	-0.010
5Y	0.235	-0.015

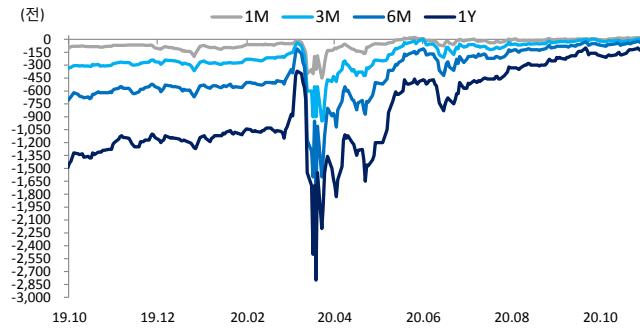
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.920	0.515	1.04	USD/KRW	1,131.45	0.85	-0.13	USD/RUB	78.8993	-0.3246	3.02
EUR/USD	1.1674	-0.0072	-1.22	USD/CNY	6.7150	-0.0140	0.45	USD/BRL	5.7816	0.0325	3.40
USD/JPY	104.61	0.29	-0.24	USD/HKD	7.7518	0.0017	0.02	USD/ZAR	16.3976	0.0198	1.16
GBP/USD	1.2930	-0.0053	-1.17	USD/SGD	1.3671	0.0018	0.75	USD/MXN	21.3615	0.0732	1.81
USD/CHF	0.9152	0.0047	0.89	USD/TWD	28.755	0.007	-0.05	USD/PLN	3.9607	0.0163	2.29
AUD/USD	0.7029	-0.0016	-1.25	USD/INR	74.11	0.24	0.78	USD/TRY	8.2910	0.0248	4.49
NZD/USD	0.6629	-0.0010	-0.70	USD/IDR	14,625	-25	-0.23	USD/SEK	8.9300	0.0818	1.87
USD/CAD	1.3325	0.0002	1.44	USD/THB	31.237	0.049	-0.11	USD/NOK	9.5424	0.1716	3.12

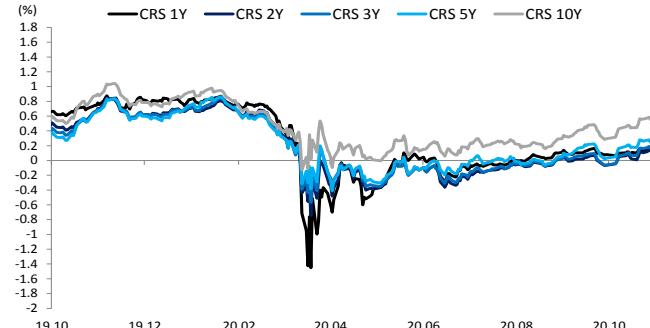
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



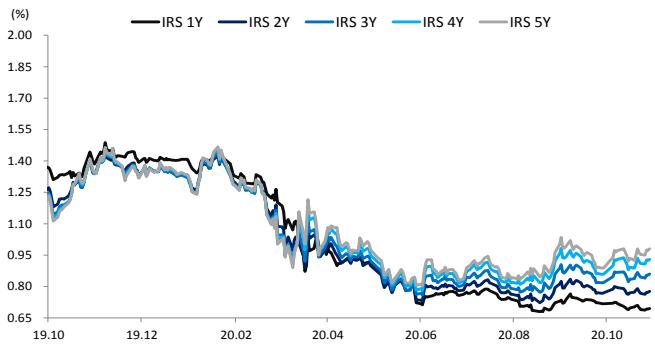
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



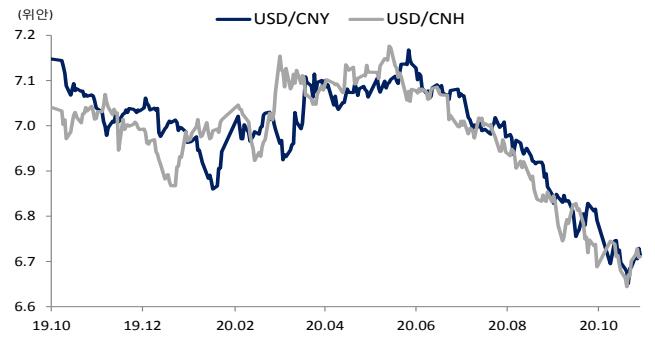
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



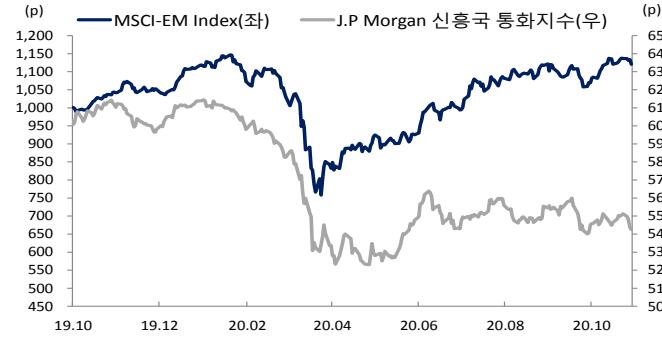
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



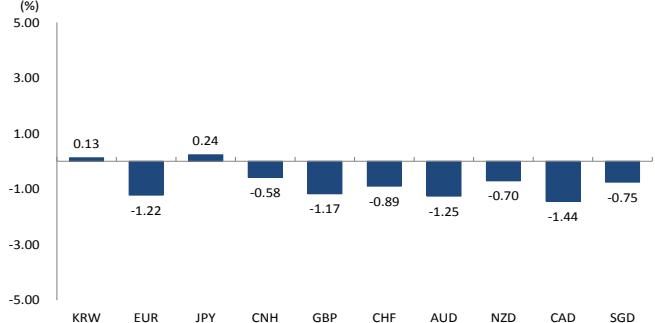
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



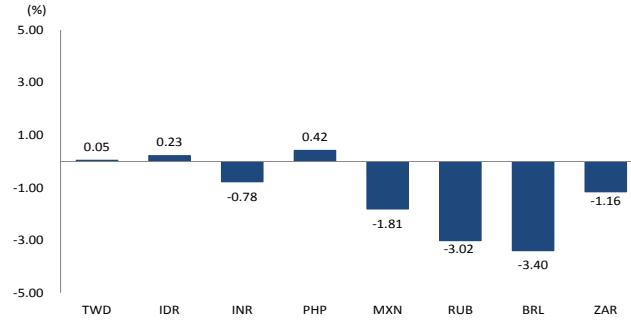
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터