

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD011	1,134.00	▼0.4	4.3	791,579
USD012	1,133.40	▼0.8	3.8	6,273
USD/KRW	1,133.60	▼1.5	3.8	
USD/CNY	6.6898	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

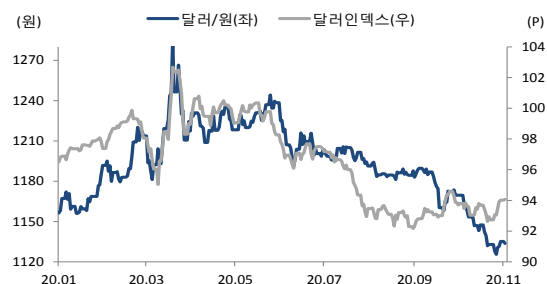
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	94.064	▲0.0260	UST2Y	0.1564
EUR/USD	1.1639	▼0.0008	UST10Y	0.8502
USD/JPY	104.77	▲0.1100	UST30Y	1.6211
GBP/USD	1.2918	▼0.0029	WTI	36.98

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(11/02)	금 일(11/03)	익 일(11/04)
17:55 독일 10월 마켓 제조업 PMI(F)(결과:58.2, 잠정:58.0)	08:00 한국 10월 CPI YoY(예상:0.8%, 이전:1.0%)	10:45 중국 10월 차이신 서비스업 PMI(예상:55.0, 이전:54.8)
18:00 유로존 10월 마켓 제조업 PMI(F)(결과:54.8, 잠정:54.4)	(11/04)	10:45 중국 10월 차이신 종합 PMI(예상:-- , 이전:54.5)
22:45 미국 10월 마켓 제조업 PMI(F)(결과:53.4, 잠정:53.3)	00:00 미국 9월 제조업 수주(예상:0.5%, 이전:0.7%)	17:55 독일 10월 마켓 서비스 PMI(F)(예상:54.5, 잠정:54.5)
00:00 미국 10월 ISM 제조업지수(결과:59.3, 이전:55.4)	00:00 미국 9월 내구재 주문(F)(예상:-- , 잠정:1.9%)	18:00 유로존 10월 마켓 서비스 PMI(F)(예상:46.2, 잠정:46.2)
00:00 미국 10월 ISM 구매물가지수(결과:65.5, 이전:62.8)		22:15 미국 10월 ADP 민간고용(예상:650k, 이전:749k)
		23:45 미국 10월 마켓 서비스 PMI(F)(예상:56.0, 잠정:57.8)
		00:00 미국 10월 ISM 서비스지수(예상:57.5, 이전:57.8)

美 대선, 불확실성은 여전

금일 달러/원 예상 : 1,130.00~1,136.00

NDF 최종호가 : 1,133.20/1,133.60(-0.30)

야간달러선물 증가 : 1,134.00원 | 고가:1,135.20원 | 저가:1,133.10원

전일 국내 동향

달러/원은 전일대비 1.9원 상승한 1,137원에 개장. 오전 중 역외 위안 강세에 낙폭을 확대하며 1,133.3원 까지 저점을 낮춤. 다만 대선을 앞둔 관망 심리 우위에 큰 변동폭을 보이지 않은 채 1,130원 중반에서 횡보 지속. 이에 환율은 전일대비 1.5원 하락한 1,133.6원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 대선을 하루 앞둔 불확실성 확대와 중국, 미국 등 주요국 경기지표 호조에 따른 경기회복 기대에 강세.

대선 전일 여론조사에서 바이든 후보와 민주당의 당선 가능성이 높게 나타나 자 블루웨이크에 대한 기대가 고조. 다만 경합주에서의 지지율 격차 축소와 트럼프의 불복 시나리오 등에 대한 우려 속 안전선호 회복에 달러는 강세 마감.

이날 발표된 경기 지표는 호조. 아시아 장에서 중국 차이신 PMI가 10년래 최고치를 기록한데 이어 미국 10월 ISM 제조업 PMI가 59.3을 기록. 이는 예상치(56.0) 상회와 함께 2년래 최고치를 상회하는 수치.

유로화는 유로존 제조업 PMI가 예상을 상회하는 등의 지표 호조에도 코로나 19에 대한 우려가 지속되며 하락. 프랑스, 독일, 영국에 이어 포르투갈, 오스트리아, 벨기에 등도 외출제한 등을 포함한 봉쇄 수위 격상을 발표하자 락다운 조치에 따른 경기 둔화에 대한 우려가 확대.

금일 전망

금일 달러/원은 역외 차액결제선물환 시장 증가를 반영하여 소폭 하락 출발을 예상하나 미 대선을 앞둔 관망세 속 보험권에서 좁은폭 등락을 예상.

간밤 코로나19 재확산 우려에도 바이든 후보의 우세를 전망하는 여론조사 발표에 블루웨이크와 불확실성 완화 기대 속 글로벌 증시 등 위험자산이 일제히 상승. 이는 금일 아시아 주요 시장에서의 위험선호 회복을 자극하며 환율 하락에 영향 가능한 요인. 예상을 상회하며 10년래 최고치를 경신한 제조업 지표에 위안화 강세가 견조한 흐름을 보이는 점 또한 환율에 하방 압력으로 작용.

다만 하단에서 대기하는 저가매수, 결제 실수요 물량의 유입과 최근 1,120원대에서 하단을 지지한 당국의 미세조정 경계는 금일 하단의 경직성을 제공할 것으로 보임. 이에 금일 환율은 미 대선을 앞두고 여전한 불확실성 속 포지션 플레이에 대한 부담 속 관망세를 보이는 가운데 1,130원 초반을 중심으로 좁은 폭 등락 시현을 전망.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD011	1,134.00	-0.40	1,137.00	1,137.60	1,133.30	4.30	302,903	-85,900	791,579	-6,997
USD012	1,133.40	-0.80	1,137.00	1,137.20	1,133.40	3.80	3,377	-1,965	6,273	84
USD SPOT	1,133.60	-1.50	1,137.00	1,137.10	1,133.30	3.80	6,407	-1,638	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	69,866	74,242	-4,376	37,965	-8,918
은행	360	1,190	-830	21,558	34,939
투신	1,437	1,240	197	6,503	-4,596
보험	588	195	393	-3,223	-712
기타법인	5,937	5,529	408	5,218	27,546
개인	30,195	31,406	-1,211	1,617	19,593
외국인	199,103	193,684	5,419	-69,637	-67,912

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,300.16	33.01
국고채3Y	0.971	0.036
국고채10Y	1.602	0.056

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	26.102	0.138

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	507	-13,471	-3,314
KOSDAQ	1,233	697	260
국고채	-3,185	-2,669	2,177
통안채	1,998	2,194	25,218

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14050	0.00025
Call	0.480	0.000	3M	0.22013	0.00438
CD	0.630	0.000	6M	0.24600	0.00387
통안1년	0.721	0.018	12M	0.33238	0.00225

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	26,925.05	423.45	1.60	-2.75
S&P	3,310.24	40.28	1.23	-2.67
나스닥	10,957.61	46.02	0.42	-3.53
FTSE 100	5,654.97	77.70	1.39	-2.37
DAX 30	11,788.28	231.80	2.01	-3.19
Nikkei 225	23,295.48	318.35	1.39	-0.85
Shanghai	3,225.12	0.59	0.02	-0.80
항셱 H	9,936.56	176.32	1.81	-1.87
미국채 2년	0.1600	0.0000	2.56	4.69
미국채 10년	0.8500	-0.0200	-2.69	6.14
WTI	36.98	1.19	3.32	-4.10
Gold	1,893.65	14.84	0.79	-0.47

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	0.10	0.00
3M	-0.25	-0.15
6M	-0.80	0.00
12M	-1.70	-0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.090	-0.010
2Y	0.105	0.015
3Y	0.145	0.020
4Y	0.155	0.020
5Y	0.185	0.015

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화

*영업일 기준으로 집계

아시아 통화

기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	94.064	0.026	1.10	USD/KRW	1,133.70	-1.45	0.52	USD/RUB	80.5313	1.0008	5.35
EUR/USD	1.1639	-0.0008	-1.45	USD/CNY	6.6909	-0.0006	-0.32	USD/BRL	5.7451	-0.0365	2.24
USD/JPY	104.77	0.11	-0.07	USD/HKD	7.7500	-0.0022	0.00	USD/ZAR	16.2042	-0.0397	-0.13
GBP/USD	1.2918	-0.0029	-0.81	USD/SGD	1.3645	-0.0019	0.23	USD/MXN	21.3890	0.2116	2.17
USD/CHF	0.9193	0.0023	1.27	USD/TWD	28.895	0.125	0.49	USD/PLN	3.9539	-0.0030	1.99
AUD/USD	0.7056	0.0028	-0.94	USD/INR	74.44	0.33	0.80	USD/TRY	8.4339	0.0890	4.30
NZD/USD	0.6633	0.0018	-0.67	USD/IDR	14,640	-10	-0.07	USD/SEK	8.9108	0.0131	1.89
USD/CAD	1.3227	-0.0094	0.11	USD/THB	31.158	-0.015	-0.38	USD/NOK	9.5633	0.0271	3.45

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point

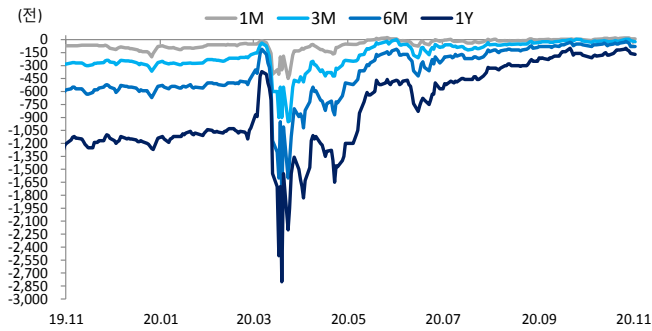


차트. CRS

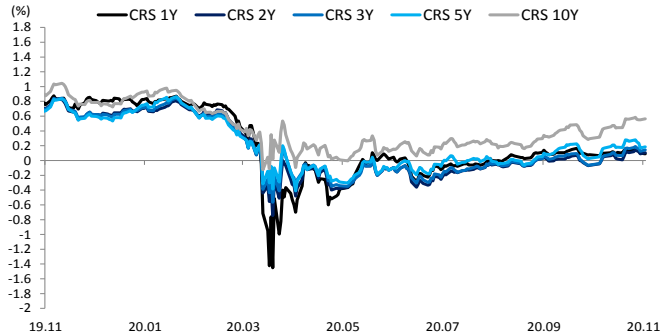


차트. IRS

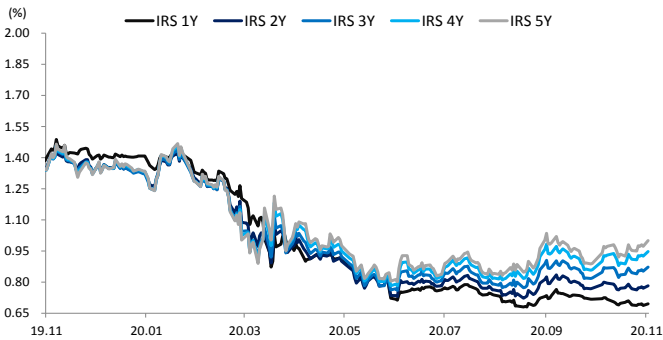


차트. CDS Premium 5Y

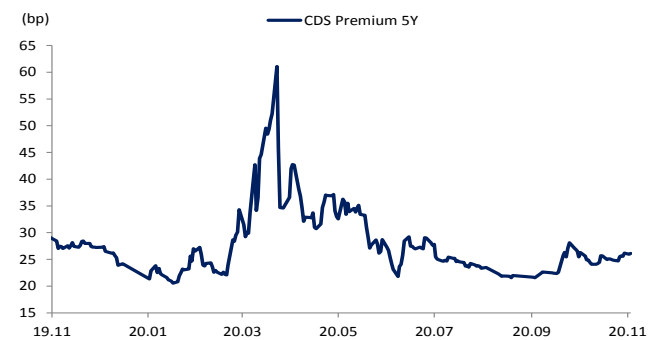


차트. 달러/위안

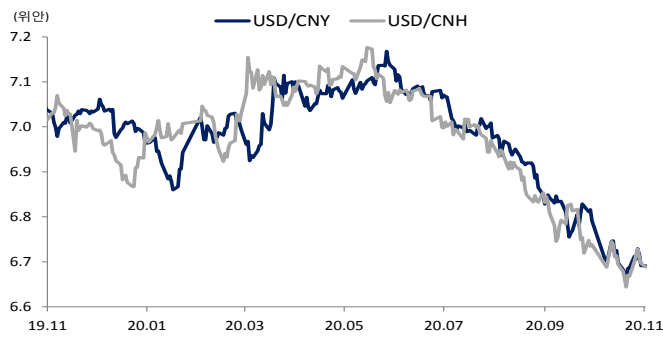


차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수

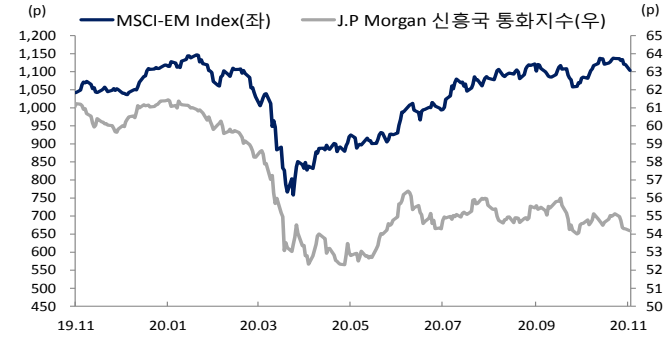


차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율

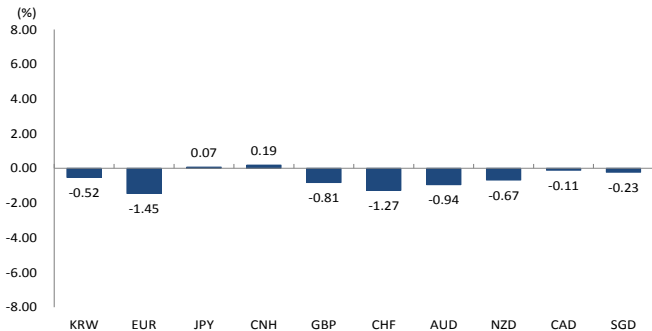


차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율

