

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일증가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD011	1,134.40	▲0.4	4.6	764,324
USD012	1,134.60	▲1.2	4.5	6,771
USD/KRW	1,134.10	▲0.5	4.3	
USD/CNY	6.6925	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

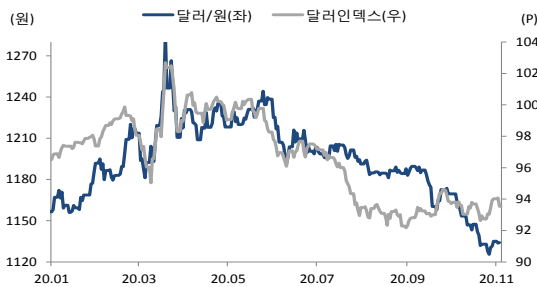
종목	전일증가	전일비(bp)	종목	전일증가
USD Index	93.412	▼0.7170	UST2Y	0.1663
EUR/USD	1.1720	▲0.0079	UST10Y	0.8959
USD/JPY	104.52	▼0.2000	UST30Y	1.6772
GBP/USD	1.3066	▲0.0149	WTI	38.05

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(11/03)	금 일(11/04)	익 일(11/05)
00:00 미국 9월 제조업 수주(결과:1.1%, 이전:0.6%)	10:45 중국 10월 차이신 서비스업 PMI(예상:55.0, 이전:54.8)	16:00 독일 9월 제조업수주 MoM(예상:2.0%, 이전:4.5%)
00:00 미국 9월 내구재 주문(F)(결과:1.9%, 잠정:1.9%)	10:45 중국 10월 차이신 종합 PMI(예상:-- , 이전:54.5)	21:00 영국 BOE 통화정책회의(예상:기준금리 동결)
	17:55 독일 10월 마켓 서비스 PMI(F)(예상:54.5, 잠정:54.5)	22:30 미국 주간 신규실업수당 청구(예상:735k, 이전:751k)
	18:00 유로존 10월 마켓 서비스 PMI(F)(예상:46.2, 잠정:46.2)	(11/06)
	22:15 미국 10월 ADP 민간고용(예상:650k, 이전:749k)	04:00 미국 FOMC 기준금리 결정(예상:기준금리 동결)
	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)	

'Blue Wave'에 베팅한 시장

금일 달러/원 예상 : 1,128.00~1,135.00

NDF 최종호가 : 1,131.30/1,131.70(-2.75)

야간달러선물 증가 : 1,132.40원 | 고가:1,133.30원 | 저가:1,130.30원

전일 국내 동향

달러/원은 전일대비 0.6원 하락한 1,133원에 개장. 대선을 앞두고 포지션 플레이에 대한 부담 속 시장은 대체로 관망세를 유지하며 좁은 폭에서 등락. 점심 무렵 1,136원대 까지 고점을 높이기도 했으나 이내 반락하며 전일대비 0.5원 상승한 1,134.1원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 대선 당일을 맞이한 가운데 시장 참여자들의 바이든 당선과 민주당의 승리 기대가 고조되자 위험선호 회복과 함께 달러는 약세.

대선 당일 시장 참여자들이 바이든과 민주당의 승리, 즉 블루 웨이브에 대한 베팅을 강화. 이는 선거 결과 불확실성 해소와 함께 대규모 재정 부양안을 통한 경기 회복 기대를 키움. 이에 전반적 위험선호가 회복. 다우지수가 2.06%, 나스닥이 1.85%를 기록하는 등 증시가 상승했고 미 국채가격과 달러는 약세.

주요 지표 발표가 부재 속 미국 경기지표는 호조. 9월 제조업수주가 전월대비 1.1% 상승하며 시장 예상치(1.0%)를 상회. 내구재주문은 예측치에 부합.

금일 전망

금일 달러/원은 역외 차액결제선물환 시장 증가와 글로벌 위험선호 회복을 반영하여 하락세 우위를 전망하나 대선 투표 경과에 따른 변동성 확대 우려 존재.

간밤 시장 참여자들의 블루 웨이브에 대한 베팅에 글로벌 위험선호무드가 회복. 이는 이머징마켓에 대한 투자 비중 확대로 유인될 가능성이 높으며 환율 하락에 우호적인 재료. 한국 시장은 이머징마켓 비중 확대의 수혜를 입을 전망. 금주들어 2,500억의 주식을 순매수한 외인 자금 유입이 지속될 가능성이 높음.

다만 최근 1,120원대에서 확인한 당국 경계와 하단에서의 결제, 실수요 유입에 1,130원 부근에서 지지선이 형성될 것으로 기대. 이는 금일 환율의 하락폭을 조절가능한 요인. 이에 더해 미 대선 개표 경과에 따른 환시 변동성 확대에서 주의해야할 것으로 보임. 격전지 중 한곳인 플로리다 주의 개표가 이르면 오전 중 발표될 수 있음. 플로리다, 텍사스 등 당일 집계가 완료되는 주에서 누가 승기를 잡느냐에 따라 트럼프의 불복 시나리오 등에 대한 셈법이 복잡해질 수 있어 주의. 이에 금일 글로벌 위험선호 회복에 하락세 우위를 예상하나 월말 이후 수급상 우위를 보이는 결제수요와 당국경계가 하락폭을 조절하며 변동성 확대를 경계하는 가운데 1,130원 중심 등락을 전망.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD011	1,134.40	0.40	1,132.70	1,136.80	1,132.20	4.60	304,635	1,732	764,324	-27,255
USD012	1,134.60	1.20	1,133.60	1,136.80	1,132.30	4.50	2,008	-1,369	6,771	498
USD SPOT	1,134.10	0.50	1,133.00	1,136.70	1,132.40	4.30	5,992	-415	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	69,681	95,692	-26,011	-2,587	5,550
은행	350	1,040	-690	205	30,273
투신	1,025	1,181	-156	4,780	-6,262
보험	67	38	29	-3,228	-498
기타법인	4,325	5,653	-1,328	2,072	20,513
개인	23,049	35,891	-12,842	-12,004	-1,277
외국인	208,872	167,874	40,998	10,762	-48,279

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,343.31	43.15
국고채3Y	0.980	0.009
국고채10Y	1.607	0.005

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	25.875	0.209

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	2,138	-12,379	-2,916
KOSDAQ	704	-970	1,010
국고채	706	-776	-1,588
통안채	0	2,501	24,219

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.13763	-0.00287
Call	0.480	0.000	3M	0.22475	0.00462
CD	0.670	0.040	6M	0.24388	-0.00212
통안1년	0.722	0.001	12M	0.33400	0.00162

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,480.03	554.98	2.06	0.06
S&P	3,369.16	58.92	1.78	-0.63
나스닥	11,160.57	202.96	1.85	-2.37
FTSE 100	5,786.77	131.80	2.33	1.01
DAX 30	12,088.98	300.70	2.55	0.21
Nikkei 225	23,295.48	318.35	1.39	-0.85
Shanghai	3,271.07	45.95	1.42	0.51
항셍 H	10,071.41	134.85	1.36	0.68
미국채 2년	0.1700	0.0100	7.64	14.45
미국채 10년	0.9000	0.0500	6.22	16.71
WTI	38.05	1.24	3.37	-3.84
Gold	1,909.06	15.41	0.81	0.02

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	0.10	0.00
3M	-0.20	0.05
6M	-0.70	0.10
12M	-1.60	0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.085	-0.005
2Y	0.100	-0.005
3Y	0.140	-0.005
4Y	0.145	-0.010
5Y	0.170	-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	93.412	-0.717	0.51	USD/KRW	1,134.15	0.45	0.77	USD/RUB	79.3615	-1.1698	2.68
EUR/USD	1.1720	0.0079	-0.64	USD/CNY	6.6776	-0.0133	-0.42	USD/BRL	5.7523	0.0072	0.81
USD/JPY	104.52	-0.20	0.10	USD/HKD	7.7524	0.0024	0.03	USD/ZAR	16.0491	-0.1773	-0.95
GBP/USD	1.3066	0.0149	0.17	USD/SGD	1.3597	-0.0057	-0.07	USD/MXN	21.1436	-0.2318	0.62
USD/CHF	0.9121	-0.0069	0.37	USD/TWD	28.763	-0.132	0.12	USD/PLN	3.8759	-0.0776	-0.33
AUD/USD	0.7166	0.0111	0.52	USD/INR	74.41	-0.03	0.94	USD/TRY	8.4038	-0.0226	2.65
NZD/USD	0.6697	0.0065	-0.19	USD/IDR	14,585	-55	-0.27	USD/SEK	8.8310	-0.0757	1.22
USD/CAD	1.3144	-0.0073	-0.31	USD/THB	31.053	-0.105	-0.63	USD/NOK	9.3748	-0.1852	2.17

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point

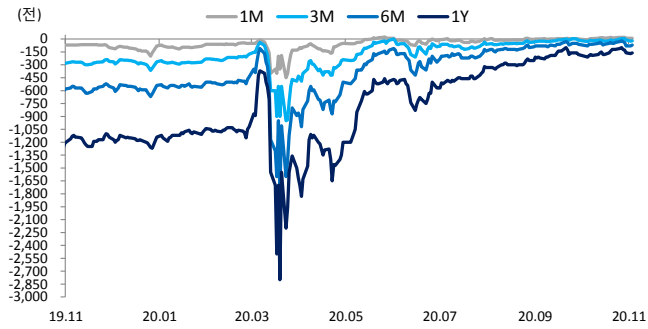


차트. CRS

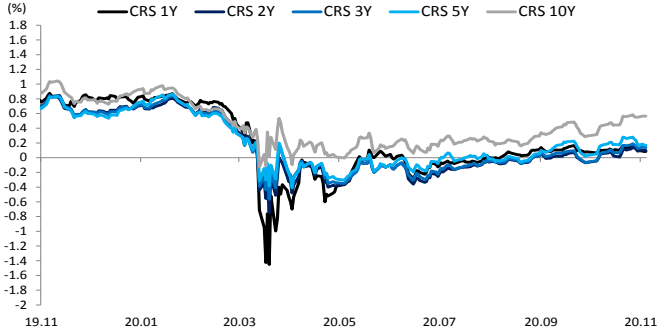


차트. IRS

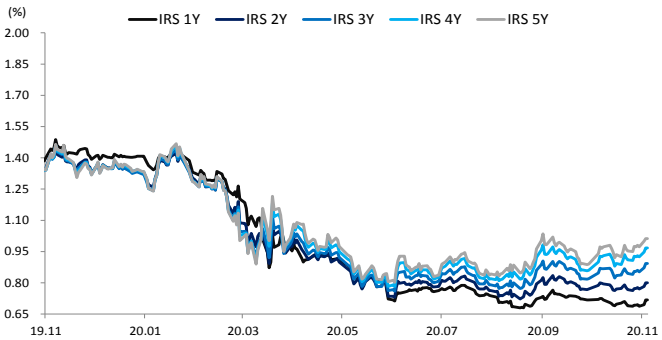


차트. CDS Premium 5Y

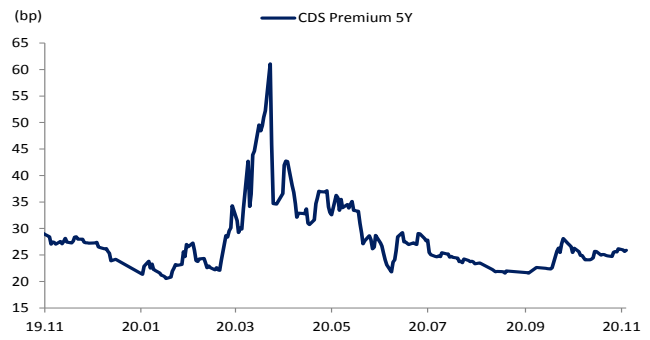


차트. 달러/위안

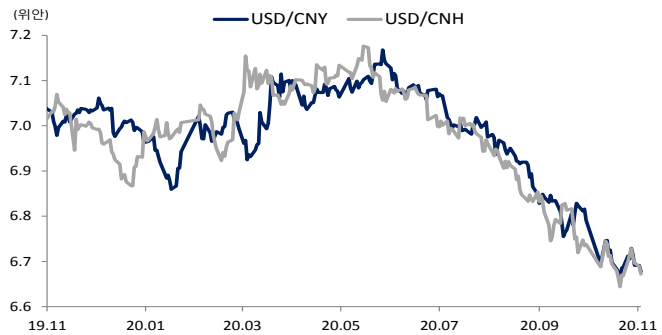


차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수

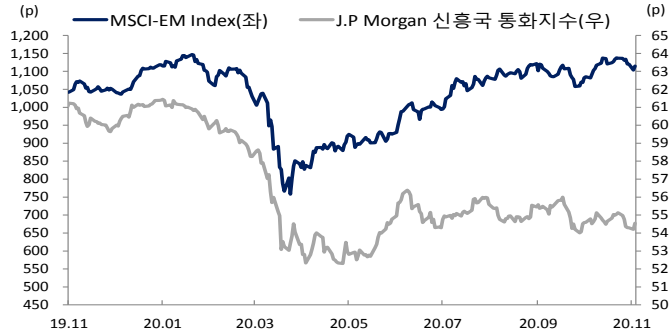


차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율

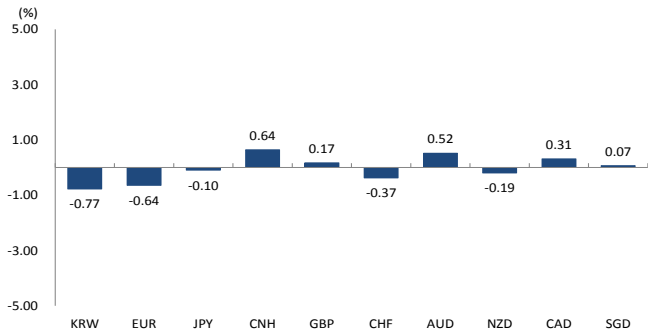


차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율

