

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

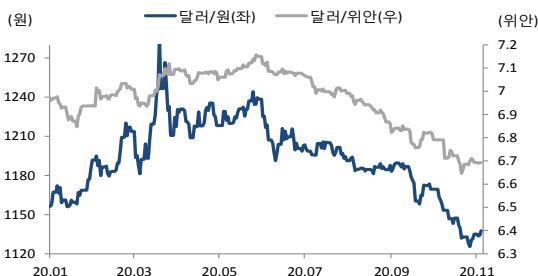
◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD011	1,138.50	▲4.1	20.9	725,674
USD012	1,138.40	▲3.8	20.2	10,431
USD/KRW	1,137.70	▲3.6	21.7	
USD/CNY	6.6932	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

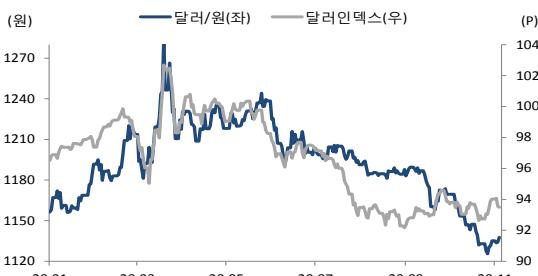
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.415	▼0.1380	UST2Y	0.1447
EUR/USD	1.1723	▲0.0008	UST10Y	0.7629
USD/JPY	104.50	▲0.0100	UST30Y	1.5424
GBP/USD	1.2989	▼0.0070	WTI	39.05

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(11/04)	
17:55	독일 10월 마켓 서비스 PMI(F)(결과:49.5 , 잠정:48.9)
18:00	유로존 10월 마켓 서비스 PMI(F)(결과:46.9 , 잠정:46.2)
22:15	미국 10월 ADP 민간고용(결과:365k , 이전:753k)
23:45	미국 10월 마켓 서비스 PMI(F)(결과:56.9 , 잠정:57.8)
00:00	미국 10월 ISM 서비스지수(결과:56.6 , 이전:57.8)

금 일(11/05)	
16:00	독일 9월 제조업수주 MoM(예상:2.0%, 이전:4.5%)
21:00	영국 BOE 통화정책회의(예상:기준금리 동결)
22:30	미국 주간 신규실업수당 청구(예상:735k, 이전:751k) (11/06)
04:00	미국 FOMC 기준금리 결정(예상:기준금리 동결)

의 일(11/06)	
16:00	독일 9월 산업생산 MoM(예상:2.5%, 이전:-0.2%)
22:30	미국 10월 실업률(예상:7.6%, 이전:7.9%)
22:30	미국 10월 비농업부문 고용자수(예상:600k, 이전:661k)
00:00	미국 9월 도매재고 MoM(F)(예상:-0.1%, 잠정:-0.1%)

바이든 유력, 블루웨이브 기대 축소

금일 달러/원 예상 : 1,124.00~1,131.00

NDF 최종호가 : 1,128.30/1,129.00(-9.25)

야간달러선물 종가 : 1,128.50원 | 고가:1,144.00원 | 저가:1,126.20원

전일 국내 동향

달러/원은 전일대비 5.8원 하락한 1,128.3원에 개장. 이날 환시는 장중 대선 개표 결과를 주시하는 가운데 변동성 장세를 나타냄. 개표 초기 트럼프 대통령의 우위 소식에 급등하여 1,148원 까지 고점을 높이기도 했으나 이내 반락. 이후 1,137원 수준에서 횡보하며 전일대비 3.6원 상승한 1,137.7원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 대선 개표 결과가 초접전 양상을 보이며 불확실성이 증대되었으나 바이든 후보의 당선 가능성 우세를 반영하여 약세 마감.

개표 초반 트럼프 대통령이 핵심 경합주 중 하나인 플로리다에서 승리하는 등 당선 가능성을 높임. 이후 위스콘신, 미시간 등 주요 경합주에서 우편투표 결과를 반영하며 바이든 후보가 역전. 아시아 시장에서 강세를 보이던 달러화는 바이든의 당선 가능성이 우세해지자 반락. 다만 트럼프 대통령이 개표중단과 재검표 요구 등 소송을 제기할 것을 시사하는 등 불확실성 증대 요소 또한 확대.

바이든은 당선 확률을 높였으나 민주당은 상원 과반 점유에 실패가 유력하여 블루 웨이브에 대한 기대가 후퇴. 이에 반독점 규제 강화와 법인세 인상 우려가 경감되며 증시 상승에 일조. 다우지수는 +1.34%, 나스닥은 +3.85%를 기록. 블루 웨이브 기대 후퇴에 국채금리 또한 큰 폭 하락.

금일 전망

금일 달러/원은 바이든 후보가 당선 가능성을 높인 대선 개표 결과를 주시하는 가운데 역외 시장 종가를 반영하여 하락세 우위를 전망.

전일 주요 경합주에서 트럼프 대통령이 선전하자 아시아 시장에서 달러화가 반등. 이후 개표 결과를 주시하며 관망세를 보임. 밤사이 우편 투표를 반영하여 바이든 후보 당선 확률이 높아진 점에 금일 환율은 큰 폭의 되돌림을 보일 것으로 전망. 공화당의 상원 사수로 반독점 규제 강화 등에 대한 우려가 경감하며 미 증시가 위험선호로 반응한 점 또한 긍정적. 이는 금일 국내시장 자금 유입과 함께 달러/원에 하방 압력을 가중시킬 수 있음.

다만 트럼프 대통령이 우편 투표의 위법성을 주장하며 개표 중단, 재검표에 대한 소송전을 준비한다는 점은 미국 정치적 불확실성 확대로 이어질 가능성이 있어 주의. 소송전 돌입 등으로 행정부 공백 발생시 S&P 등 주요 신용평가사에서 경고했듯 신용등급 강등의 우려가 있어 금융시장 변동성이 확대 가능. 단기간 급락에 1,120원대에서의 저가매수 수요 유입도 하단을 지지.

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD011	1,138.50	4.10	1,129.20	1,147.70	1,126.80	20.90	942,400	637,765	725,674	-38,650
USD012	1,138.40	3.80	1,130.60	1,147.20	1,127.00	20.20	12,883	10,875	10,431	3,660
USD SPOT	1,137.70	3.60	1,128.30	1,148.00	1,126.30	21.70	8,902	2,910	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	159,795	219,377	-59,582	-78,784	-21,047
은행	2,021	13,161	-11,140	-9,514	24,745
투신	807	1,568	-761	3,376	-3,519
보험	40	73	-33	-3,181	-100
기타법인	19,532	22,031	-2,499	1,142	19,878
개인	89,939	97,186	-7,247	-7,779	-250
외국인	687,566	606,304	81,262	94,740	-19,787

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,357.32	14.01
국고채3Y	0.955	-0.025
국고채10Y	1.569	-0.038

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	25.335	-0.079

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-2,180	-14,693	-6,821
KOSDAQ	108	-1,643	1,686
국고채	675	-461	-1,609
통안채	-502	1,999	21,494

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.13613	-0.00150
Call	0.480	0.000	3M	0.23225	0.00750
CD	0.670	0.000	6M	0.24375	-0.00013
통안1년	0.715	-0.007	12M	0.33313	-0.00087

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	27,847.66	367.63	1.34	5.01
S&P	3,443.44	74.28	2.20	5.27
나스닥	11,590.78	430.21	3.85	5.32
FTSE 100	5,883.26	96.49	1.67	5.38
DAX 30	12,324.22	235.24	1.95	6.61
Nikkei 225	23,695.23	399.75	1.72	0.89
Shanghai	3,277.44	6.37	0.19	0.25
항셍 H	10,099.16	27.75	0.28	1.36
미국채 2년	0.1447	-0.0216	-12.99	-1.30
미국채 10년	0.7629	-0.1364	-15.17	-1.05
WTI	39.05	1.39	3.69	4.44
Gold	1,894.68	-14.38	-0.75	0.72

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.20	0.10
3M	-0.10	0.10
6M	-0.60	0.10
12M	-1.60	0.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.085	0.000
2Y	0.100	0.000
3Y	0.140	0.000
4Y	0.145	0.000
5Y	0.165	-0.005

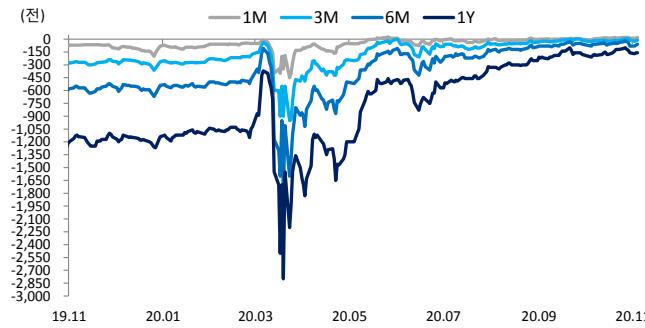
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.415	-0.138	0.01	USD/KRW	1,137.65	3.50	0.62	USD/RUB	79.3615	-1.1698	2.68
EUR/USD	1.1723	0.0008	-0.20	USD/CNY	6.6524	-0.0252	-1.14	USD/BRL	5.6648	-0.0875	-1.47
USD/JPY	104.50	0.01	0.17	USD/HKD	7.7558	0.0036	0.07	USD/ZAR	15.8489	-0.2136	-3.23
GBP/USD	1.2989	-0.0070	0.05	USD/SGD	1.3577	-0.0028	-0.56	USD/MXN	20.9291	-0.1815	-1.69
USD/CHF	0.9122	-0.0005	0.19	USD/TWD	28.817	0.054	0.24	USD/PLN	3.8742	-0.0150	-1.78
AUD/USD	0.7178	0.0014	1.89	USD/INR	74.76	0.35	1.20	USD/TRY	8.4237	0.0272	1.91
NZD/USD	0.6695	0.0009	0.84	USD/IDR	14,565	-20	-0.41	USD/SEK	8.7905	-0.0401	-0.65
USD/CAD	1.3134	-0.0010	-1.42	USD/THB	31.135	0.082	-0.17	USD/NOK	9.3217	-0.0629	-0.52

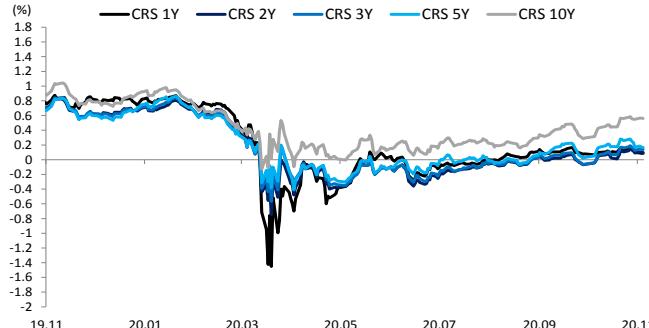
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



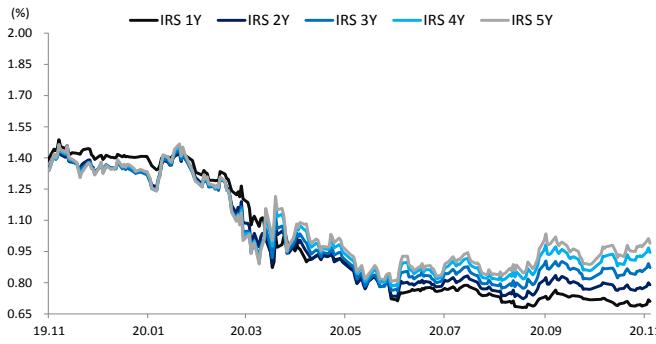
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



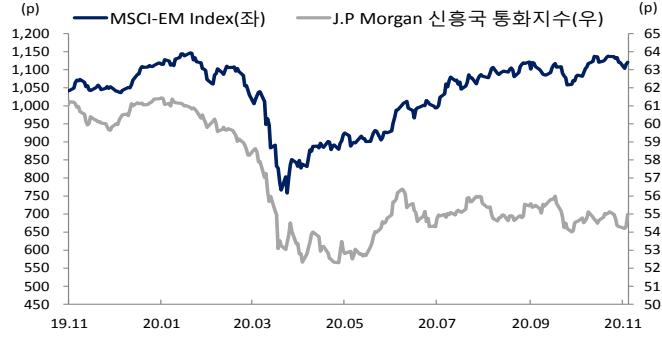
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



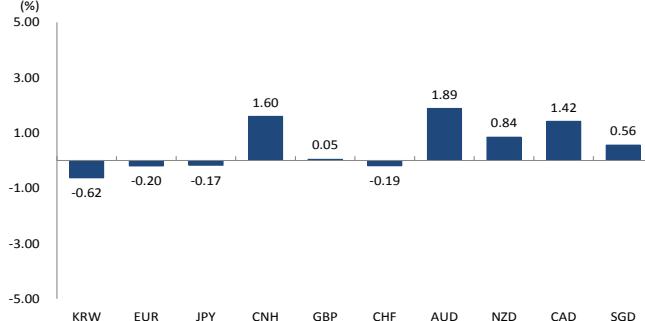
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



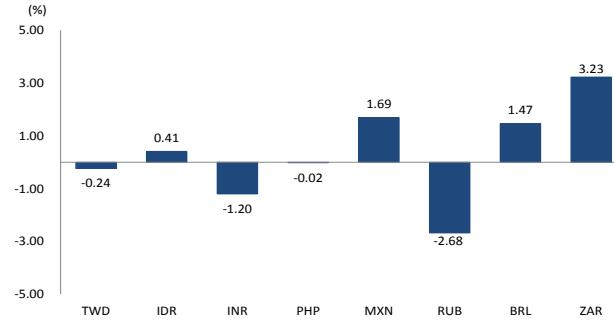
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터