

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

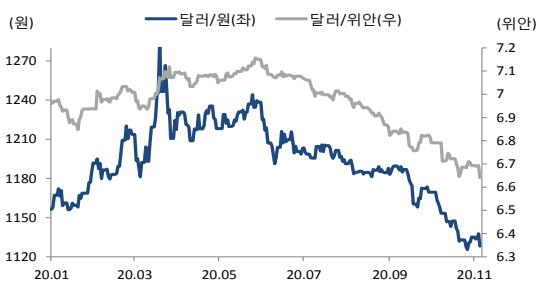
◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD011	1,128.40	▼10.1	6.6	726,204
USD012	1,128.40	▼10.0	6.4	13,909
USD/KRW	1,128.20	▼9.5	6.4	
USD/CNY	6.6412	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

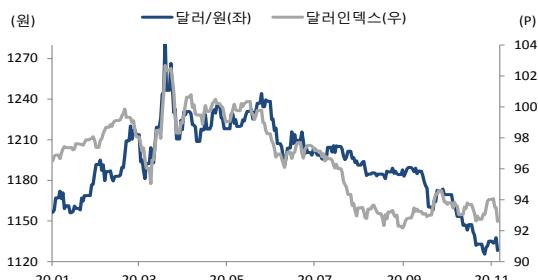
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	92.568	▼0.8390	UST2Y	0.1467
EUR/USD	1.1831	▲0.0105	UST10Y	0.7663
USD/JPY	103.52	▼1.0000	UST30Y	1.5263
GBP/USD	1.3153	▲0.0165	WTI	38.54

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(11/05)

- 16:00 독일 9월 제조업수주 MoM(결과:0.5%, 이전:4.9%)
 21:00 영국 BOE 통화정책회의(결과:기준금리 동결)
 22:30 미국 주간 신규실업수당 청구(결과:751k, 이전:758k)
 (11/06)
 04:00 미국 FOMC 기준금리 결정(결과:기준금리 동결)

금 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%)

익 일(11/09)

- 18:30 유럽 11월 센티스 투자자기대지수(예상:--, 이전:-8.3)
 (11/10)
 03:30 미국 Fed 로레타 메스터(클리브랜드, 투표권O) 총재 연설

또다시 약세 압박에 직면한 달러화

금일 달러/원 예상 : 1,119.00~1,126.00

NDF 최종호가 : 1,123.30/1,123.80(-4.95)

야간달러선물 종가 : 1,122.50원 | 고가:1,127.50원 | 저가:1,122.30원

전일 국내 동향

달러/원은 전일대비 7.7원 하락한 1,130원에 개장. 밤사이 바이든 후보의 당선이 유력해진 판세를 반영하여 장초반 10원 이상 급락하며 1,127.5원에 저점 형성. 글로벌 위험선호 확대 속 외인들의 대규모 자산 매수도 환율의 하방을 지지. 이에 환율은 전일대비 9.5원 하락한 1,128.2원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 바이든 후보의 당선이 유력해지며 전개된 위험자산 랠리와 FOMC 결과를 주시하는 가운데 낙폭을 확대.

바이든 후보가 선거인단 264명을 확보. 매직넘버인 270명을 목전에 두며 당선이 유력. 상원 집권을 통한 블루 웨이브에는 실패했지만 시장은 이를 반독점 규제, 법인세 인상에 대한 제동으로 해석하며 위험자산 랠리에 긍정적으로 소화. 트럼프 대통령의 불복 소송의 우려는 잔존하지만 미시간주에서의 개표 중단 청구에 1심 기각 판결이 나오면서 불확실성 확대 트리거로 작용하지 않음.

이날 연준은 FOMC를 통해 기준금리를 동결, 자산매입 속도는 최소한 현 수준을 유지하겠다고 밝힘. 또한 팬데믹 이전 수준을 밑도는 경기회복 수준과 향후 경로에 대한 우려를 밝힘. 영란은행 또한 통화정책회의를 열고 기준금리를 동결했으나 양적완화 규모를 1,500억 파운드 확대.

금일 전망

금일 달러/원은 미국 정치적 불확실성 축소에 따른 위험자산 랠리와 글로벌 달러 약세를 쫓아 하락세가 우위를 보일 것으로 전망.

바이든 후보의 당선이 유력해지자 증시가 위험선호로 반응. 특히 이마징 시장으로의 자금 유입이 촉발되며 신흥국으로 자금이 유입. 이는 전일 국내증시에서 1조원 이상을 순매수한 외국인 자금 유입 지속, 증시강세와 함께 달러/원에 하방 압력을 가중시킬 수 있음. 밤사이 바이든 승리 가능성 확대에 역외 위안이 강세로 반응한 점 또한 금일 달러/원에 하방 압력을 가중할 요인. 노골적 미국 우선주의와 보복관세 정책 등을 탈피하며 트럼프 행정부에 비해 미중관계가 다소 유화해질 것이라는 기대가 작용. 이에 장중 한때 달러당 6.59위안 레벨까지 하락하며 뚜렷한 강세를 시현.

다만 급격한 하락에 대한 당국의 조정 경계는 환율의 하락폭을 제한 가능. 전일 김용범 기재부 1차관은 금융시장 변동성 확대 모니터링 강화, 적극대응을 시사. 하단에서의 적극적 결제 실수요 물량 유입 또한 하락 속도 조절에 일조 가능함.

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD011	1,128.40	-10.10	1,129.50	1,134.20	1,127.60	6.60	440,292	-502,108	726,204	530
USD012	1,128.40	-10.00	1,129.40	1,134.00	1,127.60	6.40	12,777	-106	13,909	3,478
USD SPOT	1,128.20	-9.50	1,130.00	1,133.90	1,127.50	6.40	7,989	-913	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	113,611	105,066	8,545	-81,174	-43,635
은행	5,230	13,359	-8,129	-18,956	18,682
투신	5,921	9,412	-3,491	-2,770	-5,509
보험	71	2,821	-2,750	-6,780	-1,132
기타법인	9,416	7,904	1,512	1,842	14,667
개인	49,007	49,995	-988	-14,832	-6,077
외국인	272,088	266,807	5,281	122,550	22,904

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,413.79	56.47
국고채3Y	0.927	-0.028
국고채10Y	1.527	-0.042

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	24.285	0.006

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	11,349	2,033	5,481
KOSDAQ	2,688	1,863	3,970
국고채	157	73	-1,230
통안채	-452	1,547	12,104

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.12663	-0.00950
Call	0.330	-0.150	3M	0.21300	-0.01925
CD	0.660	-0.010	6M	0.24625	0.00250
통안1년	0.705	-0.010	12M	0.33375	0.00062

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	28,390.18	542.52	1.95	6.49
S&P	3,510.45	67.01	1.95	6.05
나스닥	11,890.93	300.15	2.59	6.31
FTSE 100	5,906.18	22.92	0.39	5.81
DAX 30	12,568.09	243.87	1.98	8.36
Nikkei 225	24,105.28	410.05	1.73	2.93
Shanghai	3,320.13	42.69	1.30	1.45
항셍 H	10,478.84	379.68	3.76	5.26
미국채 2년	0.1500	0.0000	1.38	0.07
미국채 10년	0.7700	0.0000	0.45	-6.89
WTI	38.54	-0.61	-1.56	6.55
Gold	1,947.70	53.02	2.80	4.28

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.25	0.05
3M	0.05	0.15
6M	-0.30	0.30
12M	-1.20	0.40

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.130	0.045
2Y	0.145	0.045
3Y	0.175	0.035
4Y	0.180	0.035
5Y	0.205	0.040

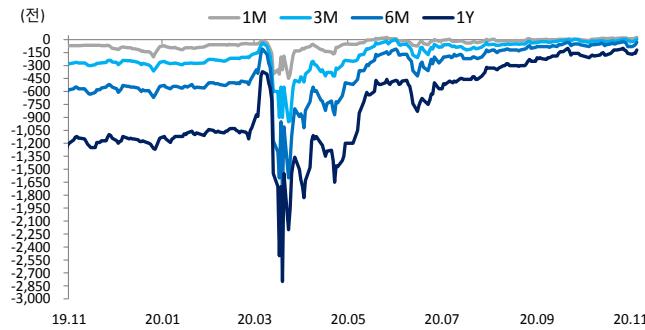
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	92.568	-0.839	-1.48	USD/KRW	1,128.30	-9.35	-0.28	USD/RUB	77.0156	-3.5157	-2.39
EUR/USD	1.1831	0.0105	1.34	USD/CNY	6.6065	-0.0459	-1.62	USD/BRL	5.5402	-0.1246	-4.18
USD/JPY	103.52	-1.00	-1.04	USD/HKD	7.7527	-0.0032	0.01	USD/ZAR	15.6859	-0.1881	-4.34
GBP/USD	1.3153	0.0165	1.72	USD/SGD	1.3498	-0.0086	-1.27	USD/MXN	20.6609	-0.2782	-3.28
USD/CHF	0.9040	-0.0079	-1.22	USD/TWD	28.700	-0.117	-0.19	USD/PLN	3.8301	-0.0436	-3.30
AUD/USD	0.7286	0.0104	3.66	USD/INR	74.39	-0.37	0.38	USD/TRY	8.4231	-0.0090	1.59
NZD/USD	0.6773	0.0078	2.17	USD/IDR	14,380	-185	-1.68	USD/SEK	8.6959	-0.0891	-2.62
USD/CAD	1.3047	-0.0089	-2.09	USD/THB	30.880	-0.255	-1.14	USD/NOK	9.1705	-0.1643	-3.90

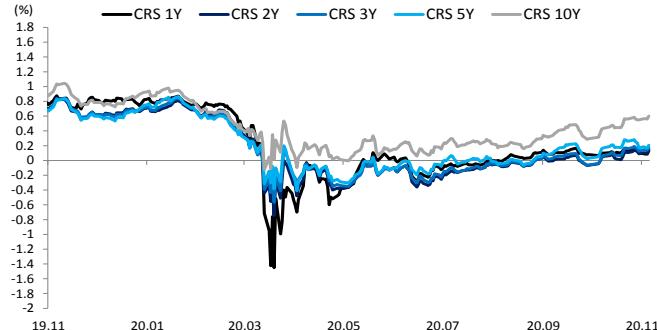
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



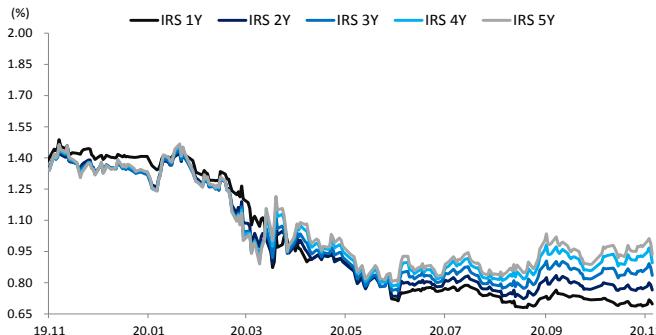
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



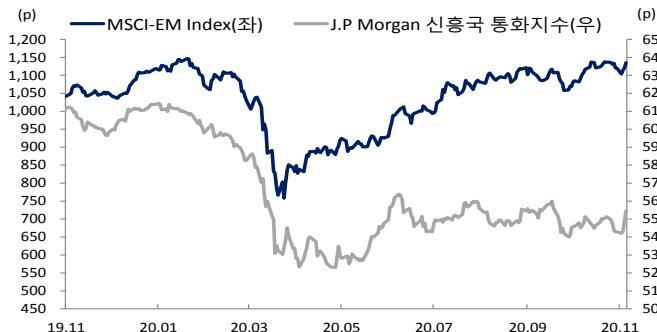
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



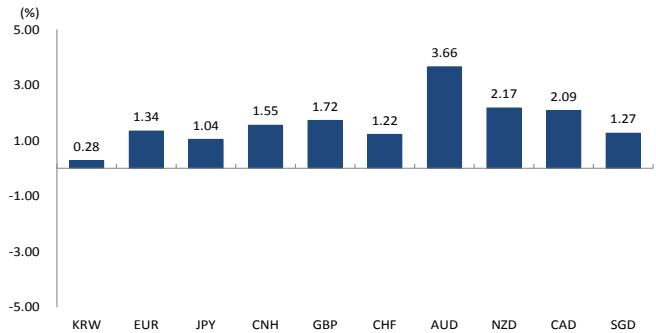
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



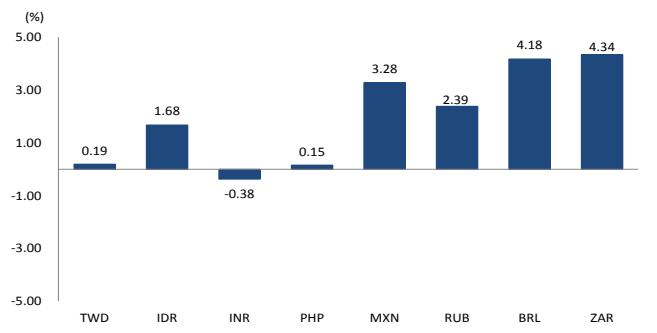
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터