

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD011	1,110.80	▼4.7	7.3	551,394
USD012	1,108.50	▼7.1	8.2	202,305
USD/KRW	1,110.00	▼5.1	6.8	
USD/CNY	6.6026	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	92.992	▲0.2430	UST2Y	휴장
EUR/USD	1.1780	▼0.0035	UST10Y	휴장
USD/JPY	105.43	▲0.1300	UST30Y	휴장
GBP/USD	1.3220	▼0.0052	WTI	41.57

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(11/11)	금 일(11/12)	익 일(11/13)
21:00 미국 MBA 주택융자 신청지수(결과:-0.5%, 이전:3.8%)	08:50 일본 10월 PPI YoY(예상:-2.0%, 이전:-0.8%)	19:00 유로존 3분기 GDP QoQ(P)(예상:12.7%, 이전:12.7%)
22:00 유럽 ECB 라가르드 총재 연설	08:50 일본 9월 핵심기계수주 MoM(예상:-1.0%, 이전:0.2%)	22:30 미국 10월 PPI YoY(예상:0.4%, 이전:0.4%)
	16:00 독일 9월 제조업생산 MoM(예상:-7.4%, 이전:-8.4%)	00:00 미국 11월 미시간대 소비자기대(P)(예상:82.0, 이전:81.8)
	22:30 미국 10월 CPI YoY(예상:1.3%, 이전:1.4%)	
	22:30 미국 주간 신규실업수당 청구건수(예상:732k, 이전:751k)	
	(11/13)	
	01:45 ECB 포럼(ECB 라가르드, BOE 베일리, Fed 파월 연설)	

1,100원 초반에서의 방향성 탐색

금일 달러/원 예상 : 1,110.00~1,117.00

NDF 최종호가 : 1,113.30/1,113.80(+3.30)

야간달러선물 증가 : 1,113.00원 | 고가:1,114.80원 | 저가:1,111.90원

전일 국내 동향

달러/원은 전일대비 0.9원 상승한 1,116원에 개장. 개장가를 고점으로 형성한 뒤 대규모 네고물량 출회와 증시강세 등 위험선호 흐름에 장중 하락 지속. 장 후반 1,100원을 하향이탈 하기도 했으나 당국 실개입 물량으로 추정되는 물량 유입에 전일대비 5.1원 하락한 1,110원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 코로나 백신 기대 약화와 바이러스 재확산 우려 속 강세 마감.

코로나 재확산에 대한 우려가 강화되며 달러화는 강세를 지속. 미국 일일 신규 확진자가 13만명을 웃돌며 최고치를 경신. 조사 방식에 따라 24시간 기준으로 20만명 이상이 넘는다는 통계도 있음. 뉴욕주는 실내 모임 제한과 식당과 주점에 대한 영업 제한 조치를 발표하며 사실상 봉쇄 수위를 강화. 미국 질병통제 예방 센터(CDC)가 향후 4주간 확진자 수가 크게 증가할 것이라 발표한 점 또한 우려 확대 요인. 이에 백신 낙관주의가 다소 약화.

유로화는 부진한 경기전망 속 약세를 보임. 라가르드 ECB 총재는 이날 코로나 백신 기대에 대한 지나친 낙관론을 경계하며 유로존의 21년 경기회복이 불안정할 수 있다 경고. 19일을 기한으로 한 EU-영국 브렉시트 회담이 촉박한 일정 속 쉽지 않을 것이라는 전망 또한 유로화와 파운드화의 하락에 일조.

금일 전망

금일 달러/원은 역외 장 종가를 반영하여 상승 출발을 예상하나 외인 자금유입 동향, 당국경계와 네고 출회 등을 주시하며 방향성 탐색을 벌일 것으로 전망.

가파른 코로나19 재확산과 이에 따른 주요 대도시 봉쇄 강화 소식은 글로벌 경기둔화 우려를 확장시켜 간밤 글로벌 달러화는 강세. 국내 환시에서는 강화된 당국 경계에 쏠 포지션에 대한 부담도 작용하며 달러/원에 상승 압력을 가중할 것으로 보임. 지속적인 금융당국에 구두개입성 발언에 이어 전일 환율이 1,100원을 하향이탈하자 실개입 물량으로 추정되는 매수세가 유입.

다만 낮아진 환율 레벨 인식에 네고물량의 대량 유입은 환율에 하방 압력을 가함. 외인 자금유입 주도하에 상승세를 이어가는 증시 흐름 또한 환율의 상단을 제한. 코스피 시장에서 전일 약 8천억원의 순매수한 외국인들은 지난 주 이후 약 3.3조원을 누적 순매수. 수출실적 호조 또한 환율하락에 우호적으로 작용 이달 1~10일 수출액은 전년동기 대비 20.1% 증가. 이에 금일 환율은 1,100원 초반을 중심으로 공방을 벌이며 방향성 탐색을 이어갈 것으로 예상.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD011	1,110.80	-4.70	1,116.30	1,116.60	1,109.30	7.30	338,749	-49,950	551,394	-137,976
USD012	1,108.50	-7.10	1,116.20	1,116.70	1,108.50	8.20	59,080	36,895	202,305	137,157
USD SPOT	1,110.00	-5.10	1,116.00	1,116.00	1,109.20	6.80	6,432	-645	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	145,959	150,471	-4,512	-38,063	-95,254
은행	78,324	76,047	2,277	-30,700	4,215
투신	57,691	50,932	6,759	15,225	17,022
보험	34,593	35,477	-884	-9,561	-6,190
기타법인	43,839	38,159	5,680	10,339	14,377
개인	39,810	34,896	4,914	17,326	2,163
외국인	254,801	269,035	-14,234	35,350	63,603

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,485.87	33.04
국고채3Y	0.989	0.013
국고채10Y	1.662	0.038

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	21.093	0.118

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	8,162	32,276	15,620
KOSDAQ	-110	-1,140	1,219
국고채	-62	2,824	2,464
통안채	1,000	4,350	12,713

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14138	0.00125
Call	0.650	0.170	3M	0.22063	0.00700
CD	0.660	0.000	6M	0.24613	0.00313
통안1년	0.725	0.004	12M	0.34188	0.00375

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	29,397.63	-23.29	-0.08	5.57
S&P	3,572.66		0.77	3.75
나스닥	11,786.43		2.01	1.69
FTSE 100	6,382.10		1.35	8.48
DAX 30	13,216.18		0.40	7.24
Nikkei 225	25,349.60		1.78	6.98
Shanghai	3,342.20	-17.95	-0.53	1.98
항셍 H	10,541.34	-45.55	-0.43	4.38
미국채 2년		휴장		
미국채 10년		휴장		
WTI	41.57	0.21	0.51	6.18
Gold	1,862.44	-19.44	-1.03	-1.70

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	0.25	0.05
3M	0.25	0.05
6M	0.20	0.10
12M	-0.20	0.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.265	0.060
2Y	0.230	0.050
3Y	0.250	0.055
4Y	0.255	0.055
5Y	0.280	0.055

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화

*영업일 기준으로 집계

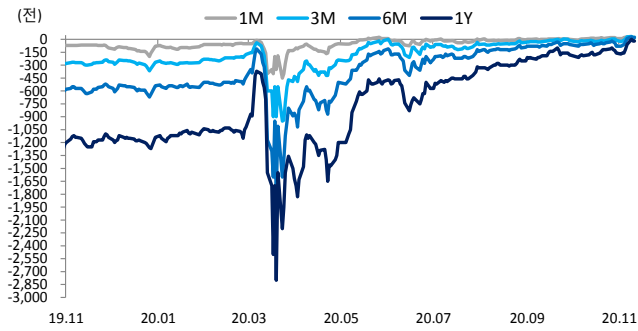
아시아 통화

기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	92.992	0.243	-0.44	USD/KRW	1,109.95	-5.15	-2.43	USD/RUB	77.1171	0.5523	-2.83
EUR/USD	1.1780	-0.0035	0.46	USD/CNY	6.6310	0.0140	-0.32	USD/BRL	5.3998	-0.0131	-4.68
USD/JPY	105.43	0.13	0.87	USD/HKD	7.7549	0.0008	-0.01	USD/ZAR	15.6344	0.0072	-1.51
GBP/USD	1.3220	-0.0052	1.79	USD/SGD	1.3494	0.0007	-0.66	USD/MXN	20.4760	0.1550	-2.21
USD/CHF	0.9169	0.0015	0.55	USD/TWD	28.672	-0.015	-0.50	USD/PLN	3.8058	0.0021	-1.75
AUD/USD	0.7278	-0.0006	1.34	USD/INR	74.37	0.19	-0.52	USD/TRY	7.8042	-0.3546	-7.45
NZD/USD	0.6883	0.0052	2.81	USD/IDR	14,085	27	-3.30	USD/SEK	8.6401	0.0225	-1.65
USD/CAD	1.3069	0.0036	-0.51	USD/THB	30.270	-0.160	-2.78	USD/NOK	9.0764	0.0619	-2.77

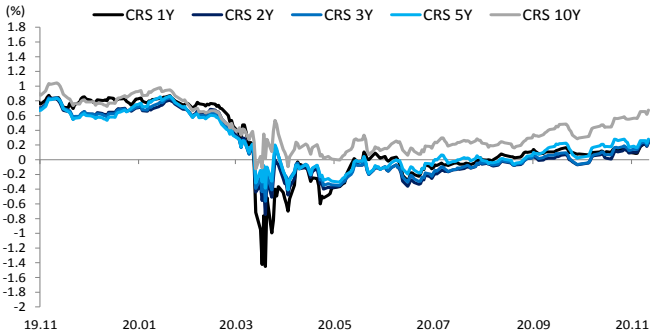
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



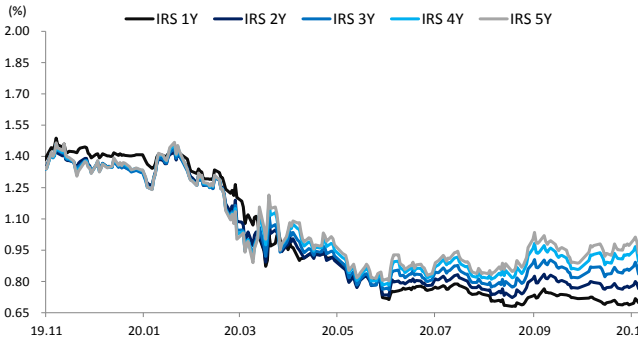
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



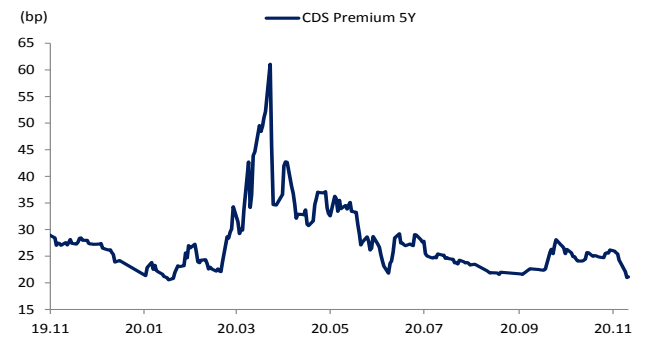
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



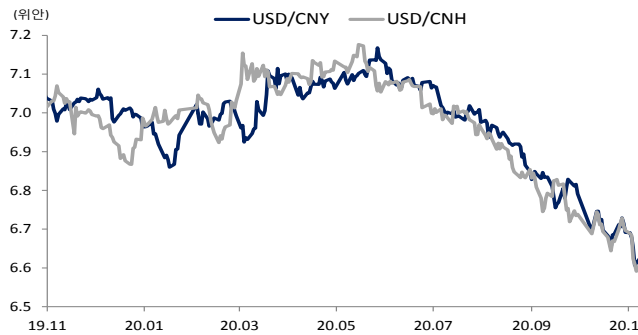
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



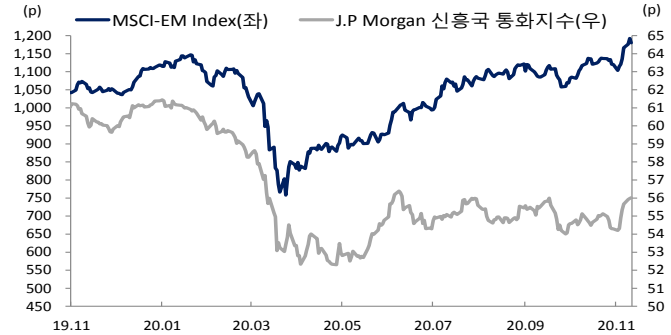
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



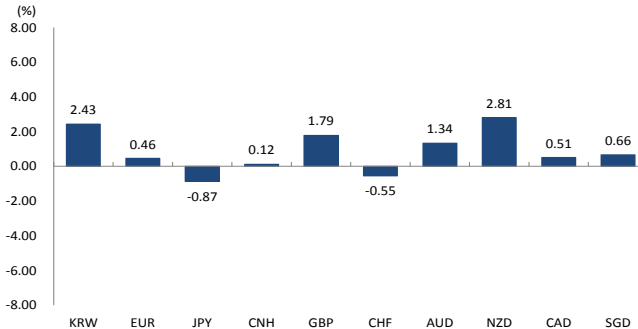
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



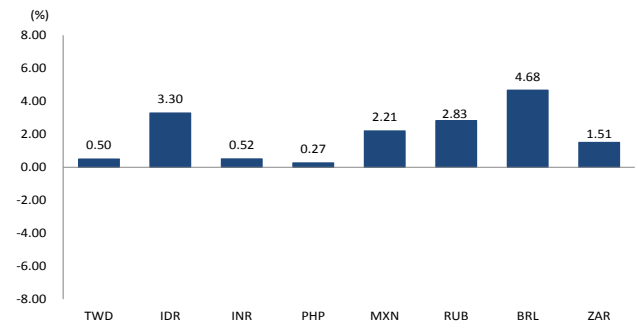
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

본 자료는 투자의 이해를 돕기 위해 참고가 되는 정보 제공을 목적으로 작성되었습니다. 당사 고객들에게 배포되는 자료로서 본 조사자료의 내용은 당사의 리서치센터에서 신뢰할 수 있는 자료와 정보를 이용하여 작성한 것이나, 당사는 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 투자자는 자신의 판단과 책임하에 투자를 하여야 하며, 본 자료는 투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙자료로 사용될 수 없습니다. 그리고 파생상품은 높은 가격변동성으로 인해 단기간에 투자원금의 전부 또는 상당부분을 손실할 수 있습니다. 본 자료는 당사 홈페이지(www.futures.co.kr)에서도 이용하실 수 있습니다.