

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

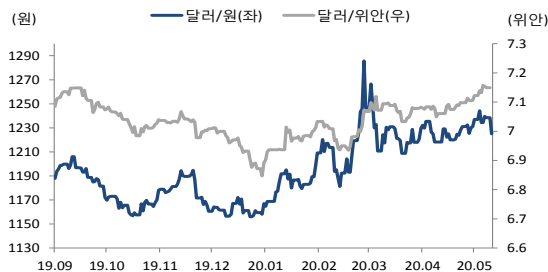
◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD006	1215.50	▼9.6	5.5	787,289
USD007	1215.10	▼10.0	5.1	5,531
USD/KRW	1216.80	▼8.6	4.9	
USD/CNY	7.1101	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	97.315	▼0.3580	UST2Y	0.1900
EUR/USD	1.1233	▲0.0063	UST10Y	0.7458
USD/JPY	108.9	▲0.2200	UST30Y	1.5305
GBP/USD	1.2575	▲0.0024	WTI	36.75

차트. 달러/위안 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 달러/인덱스 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(06/03)	금 일(06/04)	익 일(06/05)
16:55 독일 5월 마켓 종합 PMI(F)(결과:32.3, 잠정:31.4)	18:00 유럽 4월 소매판매 MoM(예상:-15.0%, 이전:-11.2%)	08:00 영국 5월 Gfk 소비자대지수(F)(예상:-34, 잠정:-34)
18:00 유럽 4월 실업률(결과:7.3%, 이전:7.1%)	20:45 유럽 ECB 통화정책회의 기준금리결정(예상:동결)	15:00 독일 4월 공장주주 MoM(예상:-19.9%, 이전:-15.6%)
21:15 미국 5월 ADP 취업자변동(결과:-2760k, 이전:-19557k)	21:30 미국 4월 무역수지(예상:\$49.2b, 이전:\$44.4b)	21:30 미국 5월 비농업부문 고용자 수(예상:-8000k, 이전:-20537k)
22:45 미국 5월 마켓 종합 PMI(F)(결과:37.0, 잠정:36.4)	21:30 미국 주간신규 실업수당 청구건수(예상:1843k, 이전:2123k)	21:30 미국 5월 실업률(예상:19.5%, 이전:14.7%)
23:00 미국 5월 ISM 비제조업 지수(결과:45.4, 이전:41.8)		
23:00 미국 4월 내구재 주문(F)(결과:-17.7%, 잠정:-17.2%)		

*주 : 예상 대비 호조(상승), 예상치 부합, 예상 대비 부진(하락), Bloomberg 컨센서스 기준

ECB 통화정책 회의를 앞두고

금일 달러/원 예상 : 1,213.00~1,220.00

NDF 최종호가 : 1,215.30/1,215.70(-1.15)

야간달러선물 종가 : 1,215.50원 | 고가:1,218.90원 | 저가:1,214.80원

전일 국내 동향

전일 대비 7.4원 내린 1218원에 개장한 환율은 코스피가 2100pt를 상향 돌파하며 1214.5원까지 저점을 낮춤. 오후 들어 달러/위안 환율이 약세 전환에 하단이 지지되며 장중 낙폭을 되돌림. 이후 박스권에서 좁은 폭 등락하다 전일 대비 8.6원 내린 1216.8원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 미국 고용지표가 예상치를 상회하며 코로나19로 인한 경기 바닥이 지났다는 기대에 하락.

달러화는 통상 시장의 변동성이 크고 리스크 회피 성향이 있을 때 강할 때 수요가. 간밤 중 발표한 미국 경기지표가 위험선호 심리를 자극하여 달러화는 7거래일 연속 하락. 미국 5월 ADP 전미 고용 보고서는 비농업 부문 고용자 수가 276만 명 감소했다 발표. 시장 예측치인 900만명 감소와 수정 된 4월 수치인 1천 955만명 감소에서 큰 폭 상회. 이에 더해 미국 5월 ISM 서비스업 지수도 45.4로 예측치(44.4)와 이전치(41.8)를 웃돌. 미국 5월 마켓 서비스업 PMI도 37.5로 4월 저점 26.7에서 반등하는 모습. 뉴욕 증시는 추가 랠리를 시도, 금 현물도 1698달러까지 하락.

한편 BOE 총재 베일리는 시중은행에 올해 말에 끝나는 브렉시트 과도기가 합의 없이 끝날 수 있는 상황에 대한 대책안을 마련하라고 조언. 이에 연내 EU와 영국이 무역협정 타결이 어려울 수도 있다는 우려감 형성. 다만 파운드화는 유로화 강세 연동하여 상승 마감.

금일 전망

금일 환율은 위험선호 심리가 우위를 보이며 하락 압력이 우세할 것으로 예상. 다만 달러화 저점 매수 물량은 하단을 지지하는 요인. 금일 예정된 ECB통화정책 회의에서 추가로 PEPP 규모를 확대할 수 있다는 기대감이 형성. 다만 유로존에 속한 국가들의 동의를 얻어내야 하는 만큼 부양책이 통과되지 않을 가능성이 있음. 이러한 불확실성이 달러 숏 포지션을 주저하게 하는 요인으로 작용할 것으로 예상. 또한 유럽 마켓 종합 PMI가 4월 저점인 13.6을 통과하여 31.9까지 올라오며 안도감을 형성했지만 여전히 기준치를 하회하는 수준. 더딘 수요측면의 회복과 낮은 고용수준이 유로화 추가 강세 가능성을 일축하는 요인으로 작용.

이에 완만한 달러 약세 흐름에 연동하여 하락 압력이 우세하겠으나. ECB통화정책회의에 대한 관망세와 3월초 이래 저점 레벨까지 내려온 달러 저점 매수 물량이 유입될 가능성은 하단을 지지할 것으로 전망.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD006	1,215.50	-9.60	1,219.00	1,219.80	1,214.30	5.50	366,205	45,865	787,289	14,662
USD007	1,215.10	-10.00	1,219.20	1,219.30	1,214.20	5.10	6,596	5,357	5,531	1,064
USD SPOT	1,216.80	-8.60	1,218.00	1,219.40	1,214.50	4.90	8,217	131	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	89,179	115,666	-26,487	-23,776	-8,277
은행	23,181	1,140	22,041	29,839	66,512
투신	88	1,593	-1,505	-5,295	-37,570
보험	-	1,150	-1,150	-3,112	-7,614
기타법인	9,584	3,518	6,066	15,338	17,658
개인	31,481	29,387	2,094	22,066	5,400
외국인	216,325	218,484	-2,159	-33,230	-35,079

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,147.00	59.81
국고채3Y	0.866	0.015
국고채10Y	1.426	0.048

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	25.799	0.479

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	2,050	1,284	-23,587
KOSDAQ	-957	864	-3,142
국고채	-1,582	-3,994	19,167
통안채	-904	-1,809	19,519

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.17363	-0.00512
Call	0.480	0.150	3M	0.32663	-0.00387
CD	0.810	0.000	6M	0.47650	-0.00550
통안1년	0.650	0.015	12M	0.62250	-0.00300

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	26,269.89	527.24	2.05	2.82
S&P	3,122.87	42.05	1.36	2.86
나스닥	9,682.91	74.54	0.78	2.87
FTSE 100	6,382.41	162.27	2.61	3.88
DAX 30	12,487.36	466.08	3.88	8.54
Nikkei 225	22,613.76	288.15	1.29	5.58
Shanghai	2,923.37	1.97	0.07	3.05
항셱 H	9,967.53	91.28	0.92	4.18
미국채 2년	0.19	0.03	17.07	5.61
미국채 10년	0.75	0.06	8.84	9.37
WTI	36.75	-0.06	-0.16	12.01
Gold	1,698.88	-25.97	-1.51	-0.54

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	-0.15	-0.10
3M	-0.60	-0.35
6M	-1.80	-0.50
12M	-5.20	-0.40

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	-0.020	-0.020
2Y	-0.155	-0.015
3Y	-0.155	-0.020
4Y	-0.140	-0.005
5Y	-0.090	0.015

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

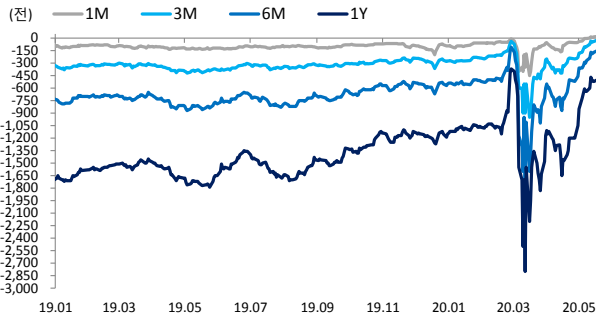
아시아 통화

기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	97.315	-0.358	-1.76	USD/KRW	1,216.90	-8.50	-1.41	USD/RUB	68.6540	-0.0513	-3.31
EUR/USD	1.1233	0.0063	2.06	USD/CNY	7.1157	0.0143	-0.73	USD/BRL	5.0650	-0.1376	-3.94
USD/JPY	108.90	0.22	1.10	USD/HKD	7.7504	-0.0006	-0.06	USD/ZAR	16.9271	-0.2357	-2.64
GBP/USD	1.2575	0.0024	2.56	USD/SGD	1.3979	-0.0025	-1.58	USD/MXN	21.7685	-0.0171	-2.53
USD/CHF	0.9612	-0.0012	-0.74	USD/TWD	29.892	-0.080	-0.42	USD/PLN	3.9253	-0.0010	-2.47
AUD/USD	0.6921	0.0024	4.52	USD/INR	75.47	0.12	-0.65	USD/TRY	6.7404	0.0260	-0.50
NZD/USD	0.6422	0.0051	3.88	USD/IDR	14,095	-320	-4.18	USD/SEK	9.2841	-0.0464	-3.47
USD/CAD	1.3495	-0.0024	-1.87	USD/THB	31.552	-0.130	-0.97	USD/NOK	9.4572	-0.0890	-4.14

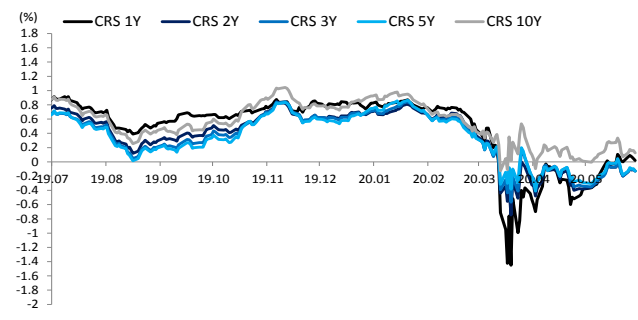
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



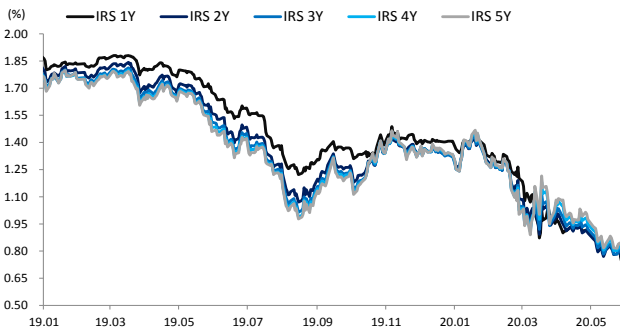
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



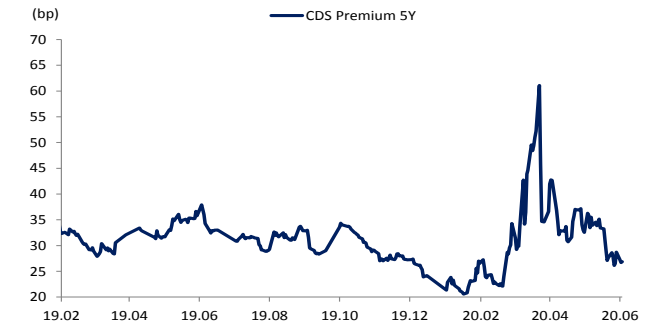
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



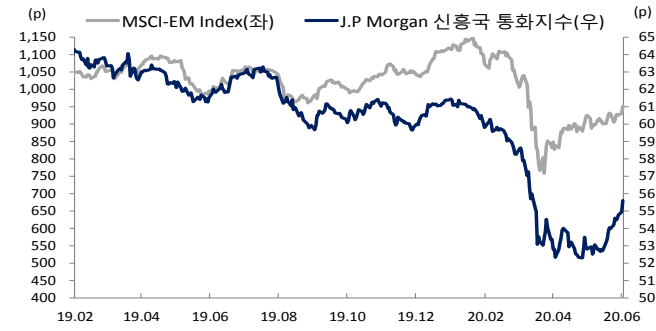
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



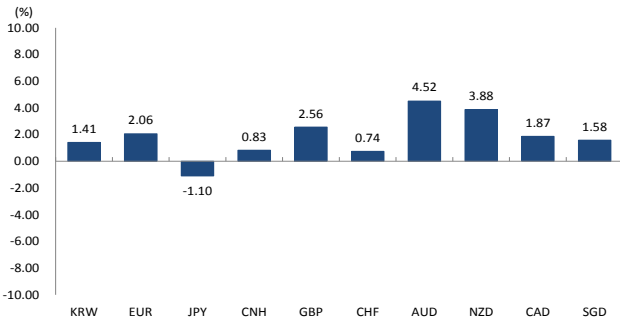
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



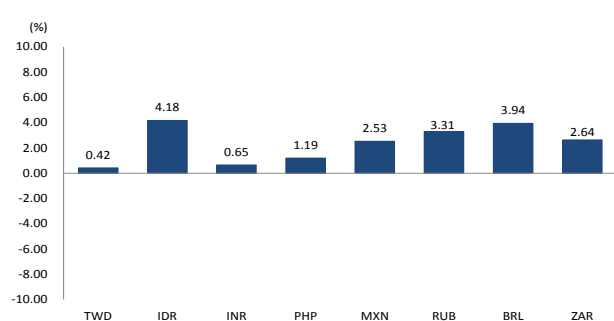
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

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.