

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

불가불 코로나 2차 감염일까

금일 달러/원 예상 : 1,202.00~1,210.00

NDF 최종호가 : 1,205.50/1,206.00(+9.80)

야간달러선물 종가 : 1,207.40원 | 고가:1,208.10원 | 저가:1,193.60원

◇ 전일 국내시장 동향

| 종목 | 전일종가 | 전일비 (원) | 변동폭 (고가-저가) | 미결제약정 (계약) |
|---------|---------|------------|----------------|---------------|
| USD006 | 1196.00 | ▲4.2 | 8.9 | 341,804 |
| USD007 | 1195.60 | ▲3.8 | 8.5 | 423,783 |
| USD/KRW | 1196.40 | ▲5.2 | 8.7 | |
| USD/CNY | 7.0713 | ▼0.0029 | 0.0083 | |

◇ 전일 해외시장 동향

| 종목 | 전일종가 | 전일비(bp) | 종목 | 전일종가 |
|-----------|--------|---------|--------|--------|
| USD Index | 96.769 | ▲0.810 | UST2Y | 0.1967 |
| EUR/USD | 1.1299 | ▼0.0075 | UST10Y | 0.6690 |
| USD/JPY | 106.87 | ▼0.2500 | UST30Y | 1.4019 |
| GBP/USD | 1.2602 | ▼0.0145 | WTI | 36.17 |

전일 국내 동향

전일 대비 1.0원 오른 1192.2원에 개장한 환율은 글로벌 달러 약세 흐름에 연동하여 1188.6원까지 저점을 낮춤. 오후 들어 아시아 주요 증시 약세 흐름 속에 위험기피심리가 우위를 보이며 환율은 약세 전환에 성공. 이후 1197.3원까지 고점을 높여 전일 대비 5.2원 오른 1196.4원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 연준의 암울한 미국 경기에 대한 진단과 미국 내 코로나19 재확산 우려로 위험선호심리가 꺾이며 상승.

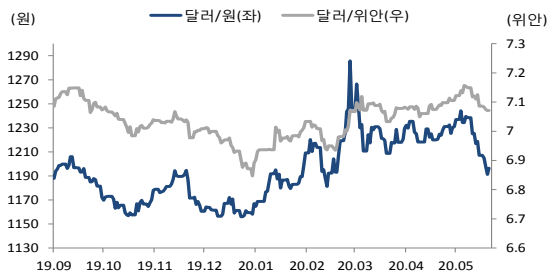
미국에서 일 평균 2만명의 코로나19 신규 확진자 발생. 텍사스 주 휴스턴에서는 팬데믹 발생 이래 가장 많은 2504명의 확진자수를 발표. 플로리다 주에서는 주간 8553명의 확진자수를 발표. 캘리포니아 주의 입원자수는 코로나19가 절정이던 5월 13일 이래 최고치를 기록. 아직 적은 규모지만 확진자 수가 증가하는 기조에 2차 감염 확산 우려가 급증. 이에 더해 전일 연준이 FOMC를 통해 미국 경기에 대해 부정적으로 진단을 내리며 미국 경기의 V자 반등에 대한 기대가 하락. 안전자산 선호 심리가 되살아나며, 달러화는 그간 경기재개 기대감으로 인한 하락세를 되돌리며 상승 마감. 대표적인 안전통화인 엔화와 스위스 프랑도 달러 대비 강세 폭을 키움.

리스크 오프에 하이베타(고위험)통화인 호주달러와 노르웨이 크로네는 달러 대비 1%이상 약세 폭을 키움. 뉴욕증시는 3월래 최대 폭 하락(장중 다우존스 약7% 하락, S&P500지수 약6% 하락). 국제유가(WTI)는 장중 배럴당 35.45달러까지 저점을 낮춤.

금일 전망

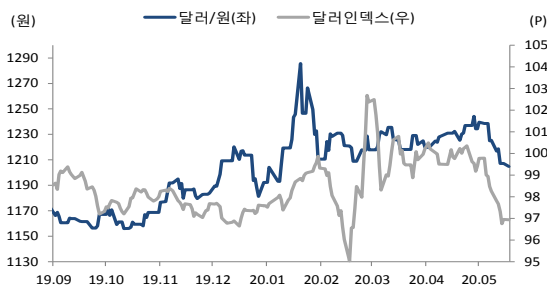
금일 환율은 코로나19 2차 감염에 대한 우려가 급부상하며 리스크 온 심리로 인한 달러 강세에 상승 압력이 우세할 것으로 전망. 전염 확진자 수가 눈에 띄게 감소하지 않은 상황에서 경기 재개를 단행한 영향에 미국 내에서 신규 코로나 확진자가 다시 증가. 국내에서도 지역 감염으로 인한 확진자가 전일 45명으로 2차 감염에 대한 우려감 여전. 이러한 우려에도 불구하고 전일 미국 므누신 재무장관은 코로나19의 재발의 상황이 발생한다 하더라도 미국 경기의 섣다른 재개될 수 없다고 발언. 아직 백신이 개발되지 않은 점과 신규 확진자 증가세는 지난 4월의 코로나 19 공포감을 떠오르게 하는 요인. 이에 VIX지수가 전일 대비 48% 급등한 점과 신흥국 통화 약세에 연동해 환율 고점을 높일 것으로 전망. 이에 더해 뉴욕증시 급락에 연동한 우리 증시 하락 전망은 롱심리를 키워 환율 상승에 힘을 실을 것으로 예상.

차트. 달러/위안 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 달러/인덱스 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

| 전 일(06/11) | 금 일(06/12) | 익 일(06/15) |
|---|---|---|
| 21:30 미국 5월 PPI YoY(결과:-0.8%, 이전:-1.2%) | 15:00 영국 4월 제조업 생산 MoM(예상:-15.6%, 이전:-4.6%) | 11:00 중국 5월 광공업 생산 YoY(예상:5.0%, 이전:3.9%) |
| 21:30 미국 5월 주간신규 실업수당청구(결과:1542k, 이전:1877k) | 15:45 프랑스 5월 CPI YoY(F)(예상:0.2%, 잠정:0.2%) | 11:00 중국 5월 소매판매 YoY(예상:-2.0%, 이전:-7.5%) |
| | 18:00 유럽 4월 산업생산 MoM(예상:-20.0%, 이전:-11.3%) | 21:30 미국 6월 뉴욕 제조업 지수(예상:-27.5, 이전:-48.5) |
| | 21:30 미국 5월 수입물가지수MoM(예상:0.7%, 이전:-2.6%) | 00:00 미국 Fed 로버트 카플란(달러, 투표권)총재 연설 |
| | 23:00 미국 6월 미시간대 소비자심리지수(P)(예상:75.0, 이전:72.3) | |

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

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

| 종목 | 증가 | 전일비 | 시가 | 고가 | 저가 | 변동폭 | 거래량 | 전일대비 | 미결제약정 | 전일대비 |
|----------|----------|------|----------|----------|----------|------|---------|--------|---------|----------|
| USD006 | 1,196.00 | 4.20 | 1,192.90 | 1,197.30 | 1,188.40 | 8.90 | 435,183 | 67,076 | 341,804 | -209,569 |
| USD007 | 1,195.60 | 3.80 | 1,192.60 | 1,196.50 | 1,188.00 | 8.50 | 82,967 | 881 | 423,783 | 202,978 |
| USD SPOT | 1,196.40 | 5.20 | 1,192.20 | 1,197.30 | 1,188.60 | 8.70 | 8,781 | 978 | - | - |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 구분 | 매수 | 매도 | 순매수 | 5일누적 | 20일누적 |
|------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 금융투자 | 262,369 | 247,834 | 14,535 | -6,522 | -75,422 |
| 은행 | 131,266 | 126,152 | 5,114 | -6,268 | 68,639 |
| 투신 | 101,084 | 97,538 | 3,546 | 39,505 | 2,501 |
| 보험 | 52,620 | 52,085 | 535 | -3,134 | -9,876 |
| 기타법인 | 39,283 | 38,415 | 868 | 26,140 | 39,044 |
| 개인 | 52,843 | 58,814 | -5,971 | 2,919 | 19,124 |
| 외국인 | 296,203 | 315,330 | -19,127 | -52,625 | -42,615 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

| 종목 | 주가/금리 | 전일비 |
|--------|----------|--------|
| KOSPI | 2,176.78 | -18.91 |
| 국고채3Y | 0.837 | -0.003 |
| 국고채10Y | 1.383 | -0.015 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

| 만기 | Mid | 전일비 |
|--------|--------|-------|
| CDS 5Y | 26.032 | 0.246 |

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

| 종목 | 순매수 | 5일 누적 | 20일누적 |
|--------|--------|--------|--------|
| KOSPI | -1,163 | -2,415 | -9,289 |
| KOSDAQ | -519 | 2,153 | 1,194 |
| 국고채 | 1,648 | 21,586 | 14,133 |
| 통안채 | 1,006 | 7,640 | 14,478 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

| Korea | 증가 | 전일비 | US Libor | 증가 | 전일비 |
|-------|-------|--------|----------|---------|----------|
| 기준 | 0.500 | 0.000 | 1M | 0.18475 | -0.00575 |
| Call | 0.500 | 0.040 | 3M | 0.31338 | -0.00500 |
| CD | 0.790 | 0.000 | 6M | 0.41963 | -0.00687 |
| 통안1년 | 0.659 | -0.002 | 12M | 0.60463 | -0.04087 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

| 종목 | 증가 | 전일비 | 전일비(%) | 1주(%) |
|------------|-----------|-----------|--------|--------|
| 다우지수 | 25,128.17 | -1,861.82 | -6.90 | -4.39 |
| S&P | 3,002.10 | -188.04 | -5.89 | -3.54 |
| 나스닥 | 9,492.73 | -527.62 | -5.27 | -1.28 |
| FTSE 100 | 6,076.70 | -252.43 | -3.99 | -4.17 |
| DAX 30 | 11,970.29 | -559.87 | -4.47 | -3.70 |
| Nikkei 225 | 22,472.91 | -652.04 | -2.82 | -0.98 |
| Shanghai | 2,920.90 | -22.86 | -0.78 | 0.06 |
| 항셍 H | 9,944.60 | -198.88 | -1.96 | -0.23 |
| 미국채 2년 | 0.20 | 0.03 | 18.00 | 1.39 |
| 미국채 10년 | 0.67 | -0.06 | -7.89 | -18.75 |
| WTI | 36.17 | -3.43 | -8.66 | -3.31 |
| Gold | 1,727.59 | 13.22 | 0.77 | 0.61 |

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

| 만기 | Mid | 전일비 |
|-----|-------|-------|
| 1M | -0.50 | -0.20 |
| 3M | -1.20 | -0.30 |
| 6M | -2.50 | -0.20 |
| 12M | -6.30 | -0.90 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

| 만기 | Mid | 전일비 |
|----|--------|--------|
| 1Y | -0.105 | -0.055 |
| 2Y | -0.180 | -0.055 |
| 3Y | -0.165 | -0.055 |
| 4Y | -0.125 | -0.050 |
| 5Y | -0.060 | -0.050 |

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 | 96.769 | 0.810 | 0.10 | USD/KRW | 1,196.80 | 5.50 | -1.81 | USD/RUB | 70.1923 | 1.7024 | 1.49 |
| EUR/USD | 1.1299 | -0.0075 | -0.34 | USD/CNY | 7.0650 | 0.0040 | -0.65 | USD/BRL | 4.9750 | 0.0740 | -2.80 |
| USD/JPY | 106.87 | -0.25 | -2.09 | USD/HKD | 7.7504 | 0.0003 | 0.00 | USD/ZAR | 17.1696 | 0.6437 | 1.54 |
| GBP/USD | 1.2602 | -0.0145 | 0.04 | USD/SGD | 1.3931 | 0.0098 | -0.37 | USD/MXN | 22.7679 | 0.9226 | 3.88 |
| USD/CHF | 0.9442 | 0.0004 | -1.18 | USD/TWD | 29.696 | 0.025 | -0.69 | USD/PLN | 3.9605 | 0.0407 | 1.21 |
| AUD/USD | 0.6855 | -0.0143 | -1.25 | USD/INR | 75.79 | 0.19 | 0.28 | USD/TRY | 6.8416 | 0.0651 | 1.31 |
| NZD/USD | 0.6431 | -0.0105 | -0.51 | USD/IDR | 14,020 | 40 | -0.53 | USD/SEK | 9.3224 | 0.1419 | 1.40 |
| USD/CAD | 1.3629 | 0.0217 | 0.96 | USD/THB | 30.948 | -0.207 | -2.02 | USD/NOK | 9.6142 | 0.3120 | 2.78 |

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point

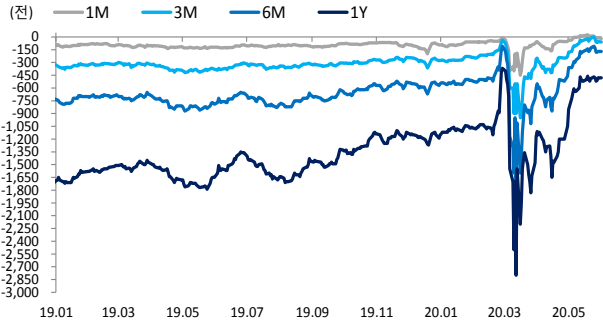


차트. CRS

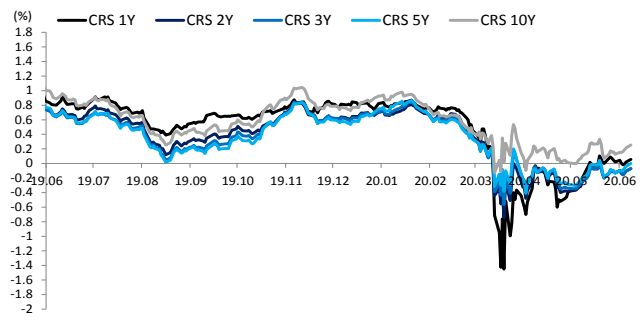


차트. IRS

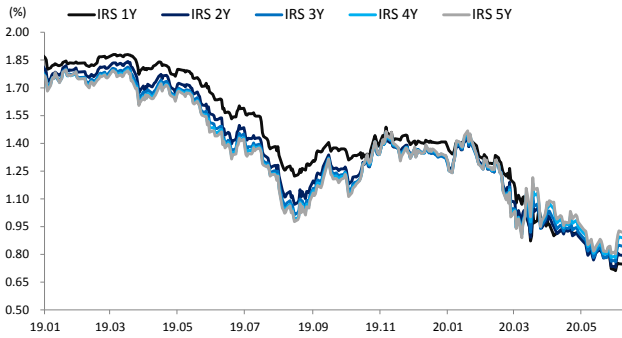


차트. CDS Premium 5Y

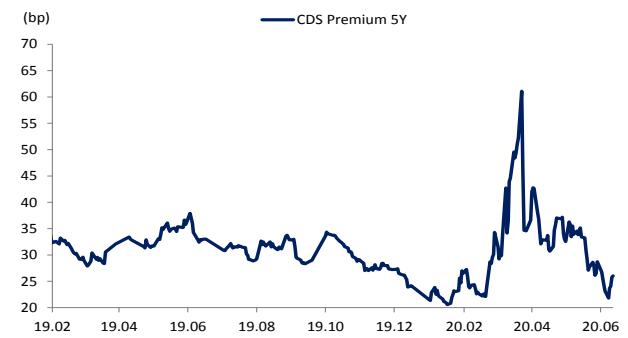


차트. 달러/위안

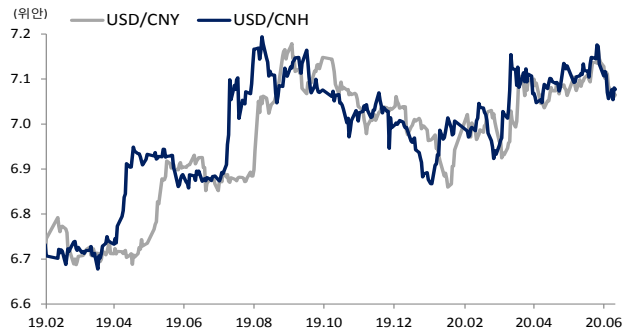


차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수

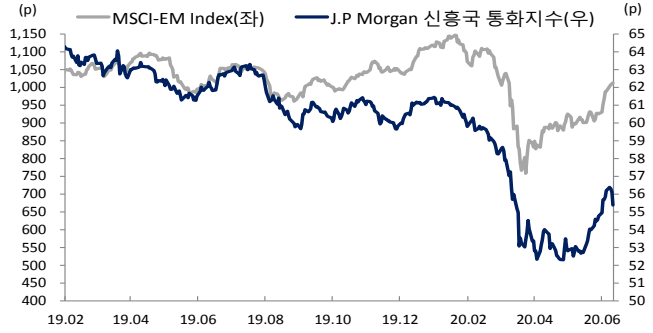


차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율

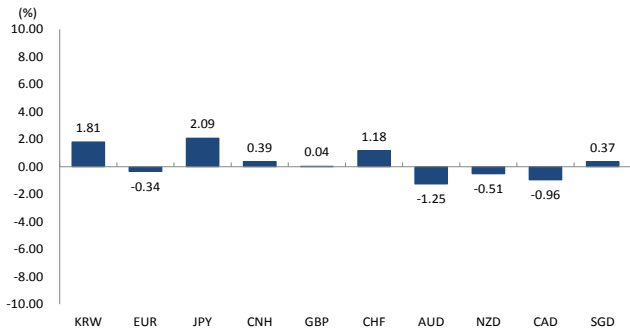


차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율

