

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

北 군사행동 지정학적 위험 부상

금일 달러/원 예상 : 1,208.00~1,216.00

NDF 최종호가 : 1,211.30/1,211.70(+4.75)

야간달러선물 종가 : 1,211.60원 | 고가:1,214.10원 | 저가:1,208.30원

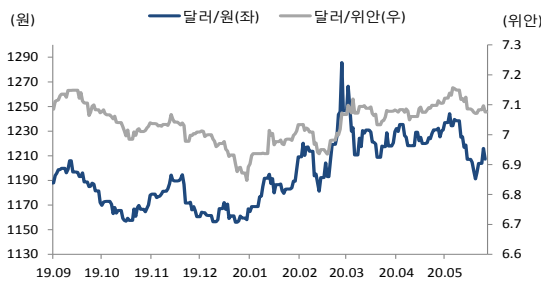
◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD007	1209.60	▼6.4	6.0	671,868
USD008	1206.70	▼7.6	3.7	335
USD/KRW	1207.20	▼8.8	4.2	
USD/CNY	7.0761	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

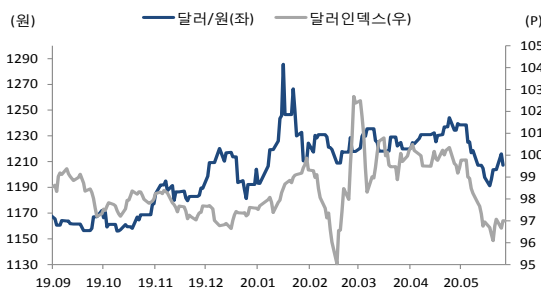
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	97.027	▲0.321	UST2Y	0.1992
EUR/USD	1.1264	▼0.0059	UST10Y	0.7528
USD/JPY	107.32	▼0.0100	UST30Y	1.5431
GBP/USD	1.2573	▼0.0032	WTI	37.93

차트. 달러/위안 & 달러/원



출처 : 인포팩스, NH선물 리서치센터

차트. 달러/인덱스 & 달러/원



출처 : 인포팩스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(06/16)	금 일(06/17)	익 일(06/18)
15:00 영국 4월 ILO 실업률 3M(결과:3.9%, 이전:3.9%)	09:30 호주 5월 웨스트팩 선행지수 MoM(예상:--, 이전:-1.50%)	10:30 호주 5월 실업률(예상:6.9%, 이전:6.2%)
15:00 독일 5월 CPI YoY(F)(결과:0.6%, 잠정:0.6%)	15:00 영국 5월 CPI YoY(예상:-0.5%, 이전:0.8%)	20:00 영국 영란은행 통화정책회의 금리결정(예상:기준금리 동결)
18:00 독일 6월 ZEW 경기심리지수(결과:63.4, 이전:51.0)	15:00 영국 5월 RPI YoY(예상:-1.2%, 이전:1.5%)	21:30 미국 6월 필라델피아 연준 경기전망(예상:-23.0, 이전:-43.1)
21:30 미국 5월 소매판매 MoM(결과:17.7%, 이전:-14.7%)	18:00 유럽 5월 CPI YoY(F)(예상:0.1%, 잠정:0.3%)	21:30 미국 주간 신규실업수당 청구건수(예상:1290k, 이전:1542k)
22:15 미국 5월 광공업 생산 MoM(결과:1.4%, 이전:-12.5%)	21:30 미국 5월 건축허가건수(예상:1250K, 이전:1066K)	23:00 미국 5월 CB 선행지수 MoM(예상:2.4%, 이전:-4.4%)
22:15 미국 5월 설비자동물(결과:64.8%, 이전:64.0%)	21:30 미국 5월 주택착공건수(예상:1100K, 이전:891K)	미국 Fed 로레타 메스터(클리블랜드, 투표권)총재 연설
	23:30 미국 DOE 주간원유재고(예상:--, 이전:5720K)	

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

전일 국내 동향

전일 대비 9.5원 내린 1207원에 갇힌 출발한 환율은 장초반 1204.7원까지 저점을 낮춤. 이후 코스피 200선물이 전일 종가대비 5% 이상 상승해 유가증권 시장에서 매수 사이드카 발동. 위험선호심리 우위 속 1200원 초반을 하단 지지선으로 좁은 폭 등락하다 전일 대비 8.8원내린 1207.2원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 미국 5월 소매판매가 급등하며 미 경기 펀더멘털이 자신감을 회복하며 상승했고, 뒤이어 파월 연준의장이 경기회복에 대해 불확실성이 남아있다는 발언을 하며 안전자산 선호심리로 추가 상승을 시도하며 강세 마감

미국 5월 소매판매는 전월 대비 17.7% 증가. 3월(-8.2%)과 4월(-14.7%) 각각 마이너스를 기록한 데에서 큰폭 반등. 5월 광공업생산도 전월 대비 1.4% 증가하여 이전치(-12.5)를 큰폭 상회. 미국 GDP의 약 66%를 차지하는 소비 부문이 회복되는 모습에 경기의 최악은 지났다는 믿음으로 미 달러는 상승.

한편 제롬 파월 의장은 고용지표와 산출량 결과는 팬데믹 이전의 수준을 큰폭 하회하고 있음을 언급. 백신이 개발되기 전까지는 경기 회복의 기간과 강도는 매우 불확실하다 언급. 연준 의장의 발언이 시장의 장미빛 기대감을 잠재워 안전자산인 달러는 추가 상승을 시도하며 97.147까지 고점을 높임.

금일 전망

금일 환율은 미국 소비지표 호조로 인한 미 달러 강세 흐름과 북한의 남북 공동연락 사무소 폭파 관련 한반도 지정학적 위험에 상승 압력이 우세할 것으로 전망.

북한의 남북 공동연락사무소가 파괴됐다는 소식에 역외 NDF환율은 상승. 이에 대응해 한국 정부는 북한의 상황에 강력히 대응할 것이라 밝힘. 북한군 대변인은 비무장지대에서 철수했던 민경초소를 전개한다 전함. 북한 도발에 따른 한반도 지정학적 위험으로 인해 달러/원은 외인 수급상 매도 우위로 추가 상승을 시도할 것으로 전망.

다만 전일 한국은행 발표 2020년 5월말 현재 외국환 은행 거주자 외화 예금은 809.2억 달러로 전월말 대비 27.4억달러 증가. 달러화 예금은 19.2억 달러 증가. 특히 기업예금이 전월 619억달러에서 29.6억달러 늘어 거주자 외화 예금 증가에 기여. 이에 간밤중 위험선호심리에도 환율이 1210원 후반까지 고점을 높일 경우 고점 인식에 따른 매도 물량 유입될 가능성 농후. 이는 환율 상단을 제한하는 요인.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD007	1,209.60	-6.40	1,206.00	1,209.60	1,203.60	6.00	375,454	-72,678	671,868	-900
USD008	1,206.70	-7.60	1,205.00	1,206.90	1,203.20	3.70	339	267	335	102
USD SPOT	1,207.20	-8.80	1,206.80	1,208.70	1,204.50	4.20	7,138	-1,283	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	71,079	101,834	-30,755	-2,597	-76,255
은행	2,082	3,451	-1,369	15,868	49,825
투신	5,948	13,851	-7,903	11,106	2,044
보험	1,242	93	1,149	3,618	-5,862
기타법인	7,920	7,496	424	4,112	31,713
개인	35,719	35,685	34	-6,843	18,296
외국인	251,020	212,750	38,270	-26,706	-19,523

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,138.05	107.23
국고채3Y	0.860	-0.001
국고채10Y	1.402	-0.022

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	27.094	-0.369

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-4,741	-9,194	-11,026
KOSDAQ	-1,322	1,043	1,793
국고채	1,154	18,465	7,741
통안채	7,796	9,911	17,467

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.19375	-0.00013
Call	0.480	0.060	3M	0.30788	0.00888
CD	0.790	0.000	6M	0.42975	-0.00113
통안1년	0.698	0.007	12M	0.58550	-0.00525

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	26,289.98	526.82	2.04	-3.60
S&P	3,124.74	58.15	1.90	-2.57
나스닥	9,895.87	169.84	1.75	-0.58
FTSE 100	6,242.79	178.09	2.94	-1.47
DAX 30	12,315.66	404.31	3.39	-2.40
Nikkei 225	22,582.21	1,051.26	4.88	-2.20
Shanghai	2,931.75	41.72	1.44	-0.82
항셍 H	9,867.63	211.80	2.19	-2.50
미국채 2년	0.20	0.01	5.40	-1.58
미국채 10년	0.75	0.03	4.34	-8.78
WTI	37.93	0.81	2.18	-2.59
Gold	1,729.03	7.66	0.44	0.79

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	-0.45	0.30
3M	-1.65	0.45
6M	-3.60	0.60
12M	-7.60	0.70

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	-0.245	0.040
2Y	-0.320	0.040
3Y	-0.255	0.050
4Y	-0.200	0.050
5Y	-0.140	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	97.027	0.321	0.73	USD/KRW	1,207.15	-9.00	0.78	USD/RUB	69.6594	0.0819	1.59
EUR/USD	1.1264	-0.0059	-0.67	USD/CNY	7.0862	-0.0046	0.12	USD/BRL	5.2445	0.0881	7.01
USD/JPY	107.32	-0.01	-0.41	USD/HKD	7.7501	-0.0003	0.00	USD/ZAR	17.2442	0.1422	3.69
GBP/USD	1.2573	-0.0032	-1.22	USD/SGD	1.3947	0.0029	0.40	USD/MXN	22.3228	0.1176	1.86
USD/CHF	0.9513	0.0021	0.05	USD/TWD	29.667	-0.051	-0.37	USD/PLN	3.9484	0.0474	0.68
AUD/USD	0.6889	-0.0030	-1.03	USD/INR	76.21	0.18	0.79	USD/TRY	6.8415	0.0272	0.65
NZD/USD	0.6451	-0.0023	-0.97	USD/IDR	14,090	-25	1.44	USD/SEK	9.3711	0.0894	1.95
USD/CAD	1.3541	-0.0031	0.92	USD/THB	31.083	-0.035	-0.86	USD/NOK	9.5686	0.0308	3.13

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point

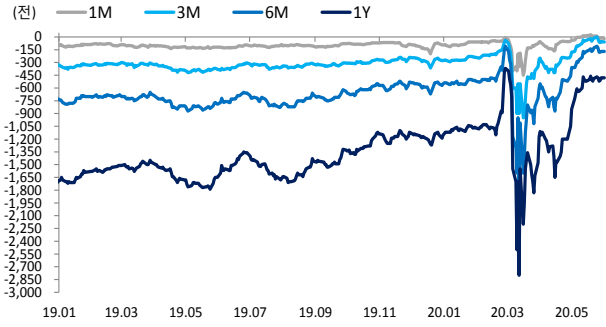


차트. CRS

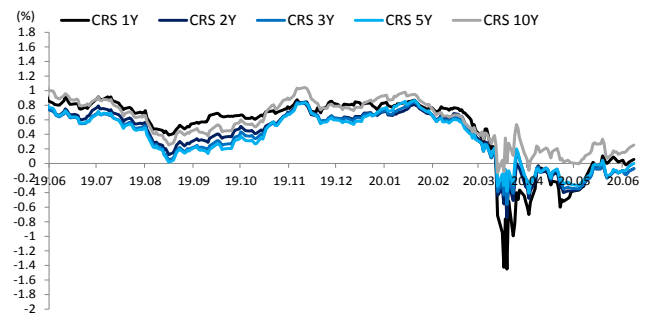


차트. IRS

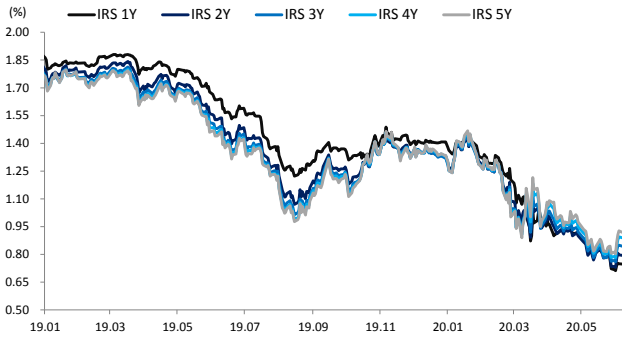


차트. CDS Premium 5Y

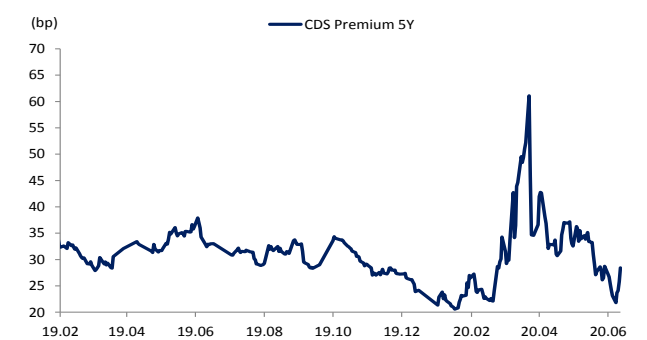


차트. 달러/위안

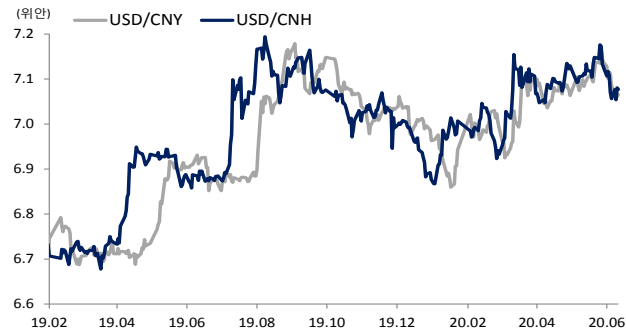


차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수

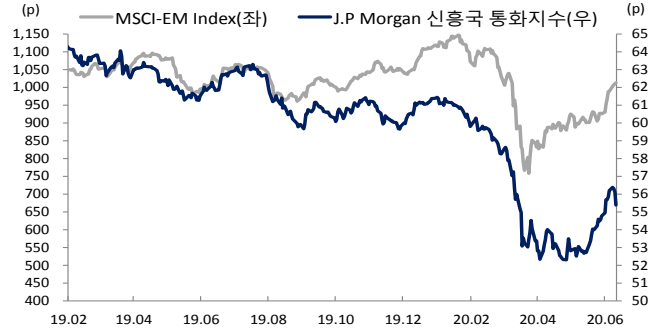


차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율

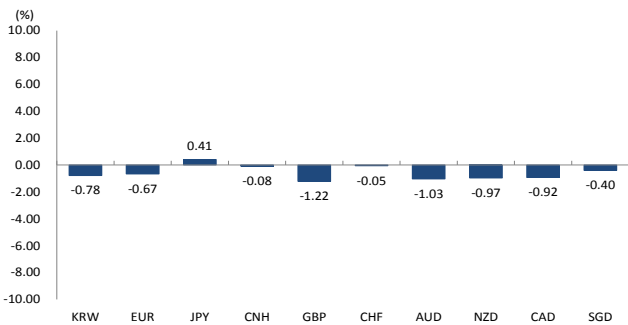
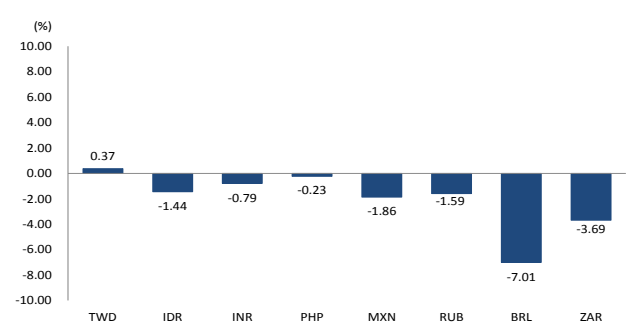


차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



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.