

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

코로나 경계에 보험성 달러 수요

금일 달러/원 예상 : 1,211.00~1,218.00

NDF 최종호가 : 1,215.10/1,215.50(+1.60)

야간달러선물 종가 : 1,214.90원 | 고가:1,214.90원 | 저가:1,212.00원

◇ 전일 국내시장 동향

| 종목 | 전일종가 | 전일비 (원) | 변동폭 (고가-저가) | 미결제약정 (계약) |
|---------|---------|------------|----------------|---------------|
| USD007 | 1213.90 | ▲4.3 | 8.2 | 678,305 |
| USD008 | 1213.30 | ▲6.6 | 7.6 | 1,346 |
| USD/KRW | 1213.90 | ▲6.7 | 8 | |
| USD/CNY | 7.0872 | ▼0.0029 | 0.0083 | |

◇ 전일 해외시장 동향

| 종목 | 전일종가 | 전일비(bp) | 종목 | 전일종가 |
|-----------|--------|---------|--------|--------|
| USD Index | 97.073 | ▲0.115 | UST2Y | 0.1952 |
| EUR/USD | 1.1244 | ▼0.0020 | UST10Y | 0.7380 |
| USD/JPY | 107.01 | ▼0.3100 | UST30Y | 1.5295 |
| GBP/USD | 1.2555 | ▼0.0018 | WTI | 37.70 |

전일 국내 동향

전일 대비 4.8원 오른 1212원에 개장한 환율은 소폭 상승한 이후 코스피 반등에 연동해 상승 폭을 줄임. 이후 위안화가 약세 전환하자 환율은 재차 상승을 시도하며 1218.6원까지 고점을 높임. 오후 들어 대북 리스크 소화된 환율은 오름 폭을 줄이며 전일 대비 6.7원 오른 1213.9원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 파월 연준 의장의 증언 대기로 인한 상승 압력이 있었으나, 코로나 2차 유행에 대한 우려에 뉴욕증시가 혼조세를 보이자 약보합 마감.

파월 연준의장은 미국 경기가 시기상 회복으로 전환하는데 중요한 위치에 있어 최근의 부양책을 성급하게 거둬들이는 것에 대한 우려를 표함. 파월의 신중한 경기 진단과 부양책 지지는 유로화는 끌어내리며 달러 강세에 일조. 미국 주요 6개 도시와 베이징에서 코로나19 확진자가 증가하는 양상. 베이징시 누적 확진자가 140명으로 베이징을 떠나려는 사람들의 출입관리를 강화. 이에 더해 아시아에서는 인도와 중국 군대간 충돌로 지정학적 위험이 지속. 중국은 인도 주변국에서 일대일로를 추진하고 인도 국경지역에서 토목 사업을 벌이며 정면 충돌. 산재한 위험들은 그 간 달러화의 편향적 수요의 주춤세를 되돌리는 요인으로 작용함.

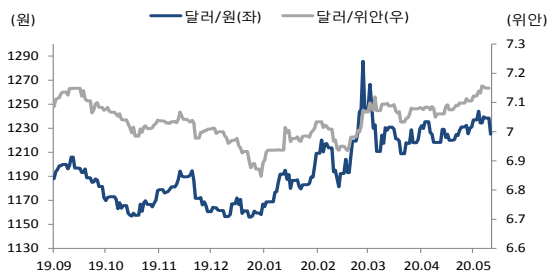
금일 전망

금일 환율은 코로나 2차 유행에 대한 우려와 선불리 경기회복세를 전망하기에는 이르다는 파월의 증언과 혼재된 경기지표 결과에 위험선호가 되돌려지며 상승 우위를 전망.

전일 발표한 미국 주택지표는 이전치를 상회하며 양호한 모습. 다만 미국 5월 주택착공건수는 97만건, 건축허가건수는 122만건으로 예상치를 하회. 엇갈린 경기지표와 베이징내 코로나 확진자 증가세에 글로벌 경기의 V자 반등에 대한 기대감은 후퇴. 이는 그간 내림세를 유지했던 글로벌 달러화를 지지하는 요인으로 작용해 환율에 상승 압력을 가할 것으로 예상. 이에 더해 대북 긴장 이슈는 외환시장 변동 요인으로 전개되지 않는 양상을 보이고 있으나 여전히 불안 요인. 전일 코스피 현물시장에서 약 520억원 가량을 순매도한 외인의 증시 순매도세 이어갈 것으로 예상되며 환율 상승 요인으로 작용.

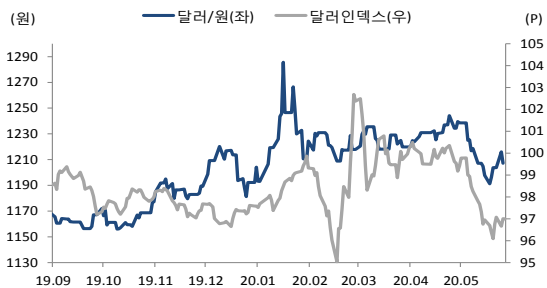
이에 금일 환율은 더딘 경기회복으로 인한 달러 매수세와 아시아 신흥국의 지정학적 위험이 산재된 점이 환율 상승 요인으로 작용할 것으로 예상.

차트. 달러/위안 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 달러/인덱스 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

| 전 일(06/17) | 금 일(06/18) | 익 일(06/19) |
|---|---|---|
| 18:00 유럽 5월 CPI YoY(결과:0.1%, 잠정:0.3%) | 10:30 호주 5월 실업률(예상:6.9%, 이전:6.2%) | 15:00 영국 5월 소매판매 MoM(예상:6.3%, 이전:-18.1%) |
| 21:30 미국 5월 건축허가건수(결과:1220k, 이전:1066k) | 20:00 영국 영란은행 통화정책회의 금리결정(예상:기준금리 동결) | 15:00 독일 5월 PPI YoY(예상:-2.0%, 이전:-1.9%) |
| 21:30 미국 5월 주택착공건수(결과:974k, 이전:934k) | 21:30 미국 6월 필라델피아 연준 경기전망(예상:-22.9, 이전:-43.1) | 21:30 미국 1분기 경상수지(예상:\$102.9b, 이전:\$109.8b) |
| 23:30 미국 DOE 주간원유재고(결과:1215k, 이전:5720k) | 21:30 미국 주간 신규실업수당 청구건수(예상:1290k, 이전:1542k) | (06/20) |
| | 23:00 미국 5월 CB 선행지수 MoM(예상:2.4%, 이전:-4.4%) | 미국 Fed 랜달 웰스 부의장 연설 |

*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 |
|----------|----------|------|----------|----------|----------|------|---------|--------|---------|-------|
| USD007 | 1,213.90 | 4.30 | 1,211.00 | 1,218.30 | 1,210.10 | 8.20 | 418,595 | 43,141 | 678,305 | 6,437 |
| USD008 | 1,213.30 | 6.60 | 1,210.50 | 1,217.50 | 1,209.90 | 7.60 | 2,241 | 1,902 | 1,346 | 1,011 |
| USD SPOT | 1,213.90 | 6.70 | 1,212.00 | 1,218.60 | 1,210.60 | 8.00 | 8,034 | 896 | - | - |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

| 구분 | 매수 | 매도 | 순매수 | 5일누적 | 20일누적 |
|------|---------|---------|--------|---------|---------|
| 금융투자 | 117,422 | 106,614 | 10,808 | 20,380 | -65,889 |
| 은행 | 2,144 | 2,281 | -137 | 8,927 | 44,143 |
| 투신 | 772 | 8,663 | -7,891 | -23,430 | -1,789 |
| 보험 | 72 | 862 | -790 | 2,936 | -5,916 |
| 기타법인 | 6,320 | 10,796 | -4,476 | -8,994 | 30,339 |
| 개인 | 35,080 | 45,005 | -9,925 | -20,850 | 13,764 |
| 외국인 | 258,293 | 246,034 | 12,259 | 19,122 | -13,816 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

| 종목 | 주가/금리 | 전일비 |
|--------|----------|-------|
| KOSPI | 2,141.05 | 3.00 |
| 국고채3Y | 0.874 | 0.014 |
| 국고채10Y | 1.409 | 0.007 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

| 만기 | Mid | 전일비 |
|--------|--------|--------|
| CDS 5Y | 27.449 | -0.025 |

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

| 종목 | 순매수 | 5일 누적 | 20일누적 |
|--------|--------|--------|---------|
| KOSPI | -528 | -8,050 | -14,972 |
| KOSDAQ | -1,135 | 2,582 | 4,106 |
| 국고채 | 0 | 7,024 | 23,140 |
| 통안채 | 0 | 9,299 | 22,800 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

| Korea | 증가 | 전일비 | US Libor | 증가 | 전일비 |
|-------|-------|-------|----------|---------|----------|
| 기준 | 0.500 | 0.000 | 1M | 0.19388 | 0.00013 |
| Call | 0.480 | 0.000 | 3M | 0.31625 | 0.00837 |
| CD | 0.790 | 0.000 | 6M | 0.42475 | -0.00500 |
| 통안1년 | 0.714 | 0.016 | 12M | 0.58388 | -0.00162 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

| 종목 | 증가 | 전일비 | 전일비(%) | 1주(%) |
|------------|-----------|---------|--------|-------|
| 다우지수 | 26,119.61 | -170.37 | -0.65 | -3.22 |
| S&P | 3,113.49 | -11.25 | -0.36 | -2.40 |
| 나스닥 | 9,910.53 | 14.66 | 0.15 | -1.10 |
| FTSE 100 | 6,253.25 | 10.46 | 0.17 | -1.20 |
| DAX 30 | 12,382.14 | 66.48 | 0.54 | -1.18 |
| Nikkei 225 | 22,455.76 | -126.45 | -0.56 | -2.89 |
| Shanghai | 2,935.87 | 4.12 | 0.14 | -0.27 |
| 항셱 H | 9,909.63 | 42.00 | 0.43 | -2.31 |
| 미국채 2년 | 0.20 | -0.00 | -2.01 | 17.10 |
| 미국채 10년 | 0.74 | -0.01 | -1.97 | 1.61 |
| WTI | 37.70 | -0.68 | -1.77 | -4.80 |
| Gold | 1,726.74 | -2.29 | -0.13 | 0.72 |

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

| 만기 | Mid | 전일비 |
|-----|-------|------|
| 1M | -0.20 | 0.25 |
| 3M | -0.95 | 0.70 |
| 6M | -2.80 | 0.80 |
| 12M | -7.10 | 0.50 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

| 만기 | Mid | 전일비 |
|----|--------|-------|
| 1Y | -0.175 | 0.070 |
| 2Y | -0.270 | 0.050 |
| 3Y | -0.210 | 0.045 |
| 4Y | -0.155 | 0.045 |
| 5Y | -0.095 | 0.045 |

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 | 97.073 | 0.115 | 1.16 | USD/KRW | 1,214.00 | 6.85 | 1.91 | USD/RUB | 69.7346 | 0.0752 | 1.82 |
| EUR/USD | 1.1244 | -0.0020 | -1.14 | USD/CNY | 7.0855 | -0.0007 | 0.35 | USD/BRL | 5.2284 | -0.0161 | 5.09 |
| USD/JPY | 107.01 | -0.31 | -0.10 | USD/HKD | 7.7501 | 0.0000 | 0.00 | USD/ZAR | 17.1995 | -0.0447 | 4.08 |
| GBP/USD | 1.2555 | -0.0018 | -1.51 | USD/SGD | 1.3934 | -0.0013 | 0.73 | USD/MXN | 22.3536 | 0.0308 | 2.33 |
| USD/CHF | 0.9487 | -0.0026 | 0.52 | USD/TWD | 29.639 | -0.028 | -0.11 | USD/PLN | 3.9708 | 0.0224 | 1.30 |
| AUD/USD | 0.6884 | -0.0005 | -1.63 | USD/INR | 76.17 | -0.05 | 0.75 | USD/TRY | 6.8455 | 0.0040 | 1.02 |
| NZD/USD | 0.6457 | 0.0006 | -1.21 | USD/IDR | 14,083 | -7 | 0.74 | USD/SEK | 9.3422 | -0.0289 | 1.76 |
| USD/CAD | 1.3565 | 0.0024 | 1.14 | USD/THB | 31.235 | 0.152 | 0.26 | USD/NOK | 9.5287 | -0.0399 | 2.43 |

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point

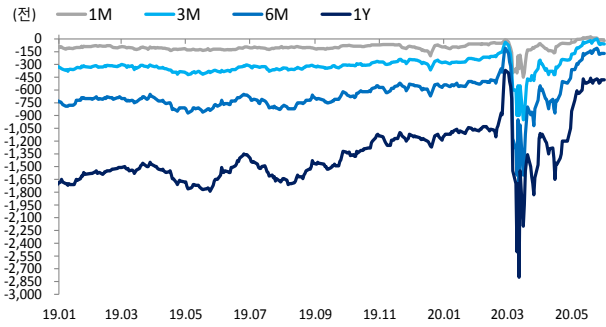


차트. CRS

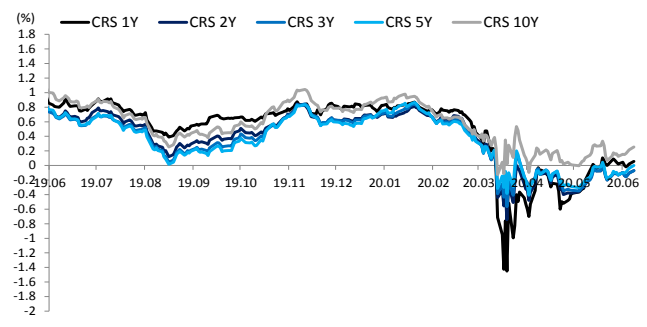


차트. IRS

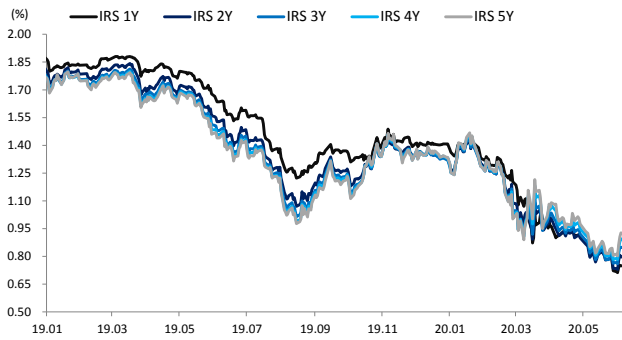


차트. CDS Premium 5Y

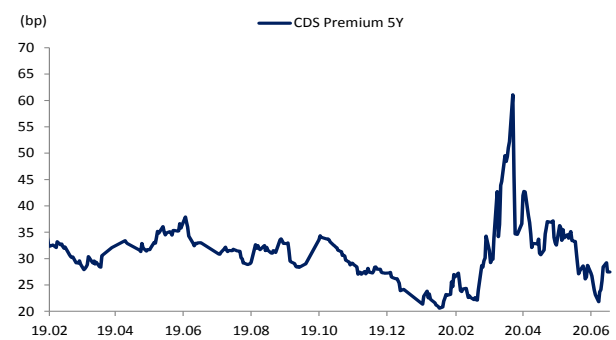


차트. 달러/위안

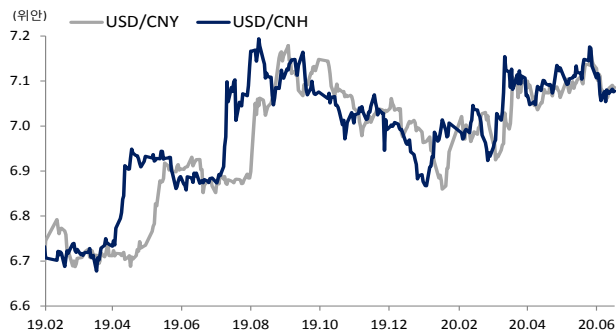


차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수

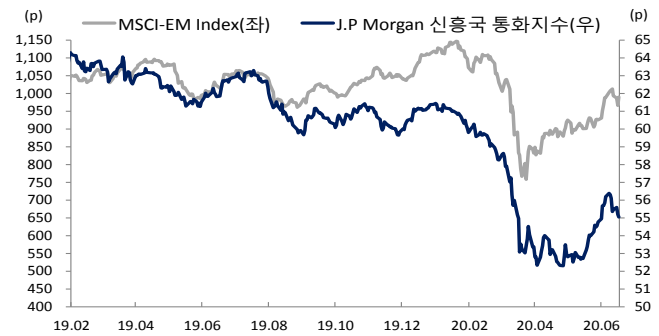


차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율

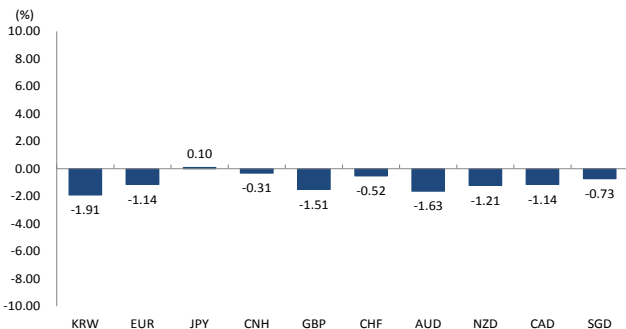


차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율

