

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

美코로나 확진자 급증, 리스크오프

금일 달러/원 예상 : 1,200.00~1,207.00

NDF 최종호가 : 1,203.70/1,204.30(+3.40)

야간달러선물 종가 : 1,203.80원 | 고가:1,204.00원 | 저가:1,098.70원

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD007	1200.50	▼4.4	4.1	651,157
USD008	1200.30	▼4.4	3.4	7,743
USD/KRW	1200.60	▼4.1	3.3	
USD/CNY	7.0782	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	97.433	▲0.004	UST2Y	0.1661
EUR/USD	1.1219	▲0.0001	UST10Y	0.6413
USD/JPY	107.22	▲0.0300	UST30Y	1.3701
GBP/USD	1.2336	▼0.0083	WTI	38.49

전일 국내 동향

전일 대비 4.7원 내린 1200원에 개장한 환율은 장 초반 1200원을 하향 돌파하며 1190원대 후반 좁은 폭 등락. 코스피 상승에 환율 하락 압력 있었으나 수입업체 결제 수요가 꾸준히 유입되어 환율 하단을 지지. 장 마감전 숏 커버 유입에 낙폭을 다소 줄여 전일 대비 4.1원 내린 1200.6원에 마감.

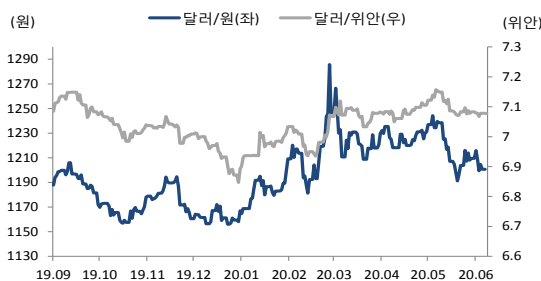
전일 해외 동향

달러화는 미국내 코로나19 재발이 V자형 경제회복에 대한 기대감을 제한하여 안전자산수요가 증가해 상승.

금일 새벽 기준 전세계 코로나 확진자수가 1007만여명. 미국내 코로나 확진자수가 254만여명으로 확진자 수가 지속적으로 증가하는 양상. 텍사스 주의 일일 코로나 확진자 수가 최고치를 경신하면서 코로나 핫스팟으로 부상. 이에 미국채 10년물 금리는 0.638%까지 저점을 낮춤. 뉴욕증시는 최근 상승세를 되돌리며 하락 마감. 한편 페이스북이 트럼프 대통령의 인종차별과 혐오발언을 방치했다는 이유로 보이콧 움직임이 일며 소셜미디어 기업의 주가가 급락.

이에 더해 6월 미시간대 소비자신뢰지수 최솜치는 78.1로 예상치(79.2)를 하회. 경기전망에 대한 소비자들의 불안감이 지속하며 안전자산 벤치마크인 달러화 강세에 일조. 5월 개인소비지수는 전월대비 8.2% 증가하며 사상 최고치 급등. 5월 개인소득지표(-4.2%)는 예상치 -6.0%를 상회했지만 시장에 미친 영향은 적었음.

차트. 달러/위안 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 달러/인덱스 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

금일 전망

금일 환율은 미국내 코로나 확진자 증가세로 인한 위험기피심리 우위를 보이며 상승 압력이 우세할 것으로 전망. 더딘 경기 회복세와는 다르게 큰폭 상승했던 뉴욕증시가 미국내 코로나 확진자수 급증에 대한 공포로 상승세를 빠르게 되돌리고 있음. IMF 발표 금융안전보고서에서는 봉쇄조피 재도입 가능성을 시사. 금일 발표한 한국은행 보고서에서도 코로나 19여파로 한국경제 성장률 하락 가속화 가능성을 전망. 이에 전반적인 리스크 오프 심리로 우리 증시 약세와 국채 강세 이어질 것으로 예상되며 환율에 상승 압력으로 작용.

한편 ECB가 채권매입 정책의 필요성을 재차 강조. 유로존 이외의 중앙은행에 유로화 유동성 제공 가능성을 시사하고 있음. EU 회복 기금 진전이 유로화를 지지하며 장중 달러 상단을 제한할 것으로 예상.

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(06/26)	금 일(06/29)	익 일(06/30)
15:45 프랑스 6월 소비자 기대지수(결과:97, 이전:93)	18:00 유럽 6월 기업경기신뢰지수(예상:--, 이전:67.5)	08:01 영국 6월 Gfk 소비자기대지수(F)(예상:29, 잠정:30)
21:30 미국 5월 개인소득 MoM(결과:-4.2%, 이전:10.8%)	18:00 유럽 6월 소비자신뢰지수(예상:--, 이전:14.7)	08:30 일본 5월 실업률(예상:2.8%, 이전:2.6%)
21:30 미국 5월 개인소비지출 MoM(결과:8.2%, 이전:12.6%)	21:00 독일 6월 CPI YoY(P)(잠정:--, 이전:0.6%)	08:30 일본 5월 광공업생산 MoM(P)(예상:-5.6%, 이전:-9.8%)
21:30 미국 5월 근원 PCE 디플레이터 YoY(결과:1.0%, 이전:1.0%)	23:00 미국 5월 미결제주매매 MoM(예상:21.5%, 이전:-21.8%)	10:00 중국 6월 제조업 PMI(예상:50.4, 이전:50.6)
23:00 미국 6월 미시간대 소비자신뢰(F)(결과:78.1, 잠정:78.9)	23:30 미국 6월 달러스 연준 제조업 활동(예상:--, 이전:-49.2)	15:00 영국 1분기 GDP QoQ(F)(예상:-2.0%, 잠정:-2.0%)
	미국 Fed 메리 테일러(샌프란시스코, 투표권)총재 연설	18:00 유럽 6월 CPI YoY(예상:-0.1%, 이전:0.1%)
		23:00 미국 6월 CB 소비자기대지수(예상:90.0, 이전:86.6)

*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	1,200.50	-4.40	1,201.20	1,201.60	1,197.50	4.10	287,978	-62,753	651,157	3,363
USD008	1,200.30	-4.40	1,200.30	1,200.70	1,197.30	3.40	5,837	3,470	7,743	3,954
USD SPOT	1,200.60	-4.10	1,200.00	1,200.80	1,197.50	3.30	6,676	-1,159	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	98,259	101,108	-2,849	-13,992	-98,762
은행	2,541	1,670	871	4,776	28,369
투신	5,706	529	5,177	24,420	44,009
보험	104	293	-189	1,194	-2,828
기타법인	7,063	5,798	1,265	2,369	34,667
개인	26,989	24,814	2,175	5,510	20,293
외국인	162,176	168,426	-6,250	-24,227	-30,562

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,134.65	22.28
국고채3Y	0.811	-0.006
국고채10Y	1.327	-0.017

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	28.984	-0.075

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	616	-1,709	-8,988
KOSDAQ	200	-815	3,642
국고채	2,261	21,878	56,406
통안채	300	11,699	28,274

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.17825	-0.00538
Call	0.530	0.200	3M	0.30788	0.00188
CD	0.790	0.000	6M	0.36138	-0.00325
통안1년	0.665	0.001	12M	0.56625	-0.00413

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	25,015.55	-730.05	-2.84	-3.31
S&P	3,009.05	-74.71	-2.42	-2.86
나스닥	9,757.22	-259.78	-2.59	-1.90
FTSE 100	6,159.30	12.16	0.20	-2.12
DAX 30	12,089.39	-88.48	-0.73	-1.96
Nikkei 225	22,512.08	252.29	1.13	0.15
Shanghai	2,979.55	8.93	0.30	1.49
항셍 H	9,853.18	-83.48	-0.84	-0.64
미국채 2년	0.17	-0.02	-10.55	-10.46
미국채 10년	0.64	-0.04	-6.46	-7.55
WTI	38.49	-0.23	-0.59	-3.17
Gold	1,763.19	-3.35	-0.19	2.30

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	0.00	0.15
3M	-0.55	0.55
6M	-2.00	0.80
12M	-5.00	1.30

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	-0.065	0.070
2Y	-0.210	0.065
3Y	-0.180	0.065
4Y	-0.130	0.065
5Y	-0.050	0.075

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

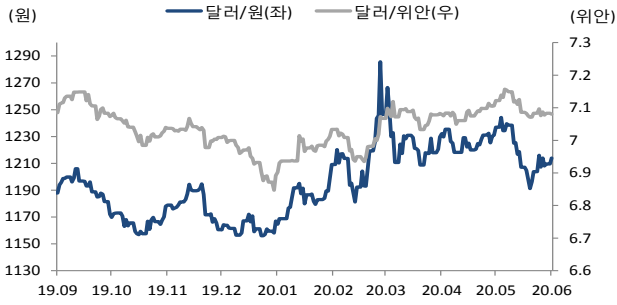
아시아 통화

기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	97.433	0.004	-0.19	USD/KRW	1,200.70	-4.00	-0.74	USD/RUB	69.7849	0.7443	0.47
EUR/USD	1.1219	0.0001	0.37	USD/CNY	7.0782	0.0201	-0.10	USD/BRL	5.4859	0.1232	3.29
USD/JPY	107.22	0.03	0.33	USD/HKD	7.7504	-0.0002	0.00	USD/ZAR	17.2956	0.1466	-0.21
GBP/USD	1.2336	-0.0083	-0.11	USD/SGD	1.3935	0.0021	-0.28	USD/MXN	23.0520	0.3921	1.85
USD/CHF	0.9477	-0.0008	-0.48	USD/TWD	29.576	-0.048	-0.21	USD/PLN	3.9854	0.0152	-0.31
AUD/USD	0.6865	-0.0022	0.44	USD/INR	75.65	-0.02	-0.71	USD/TRY	6.8600	0.0048	0.11
NZD/USD	0.6423	-0.0006	0.25	USD/IDR	14,220	45	0.85	USD/SEK	9.3366	0.0229	-1.45
USD/CAD	1.3688	0.0050	0.60	USD/THB	30.923	-0.009	-0.27	USD/NOK	9.6979	0.0368	0.54

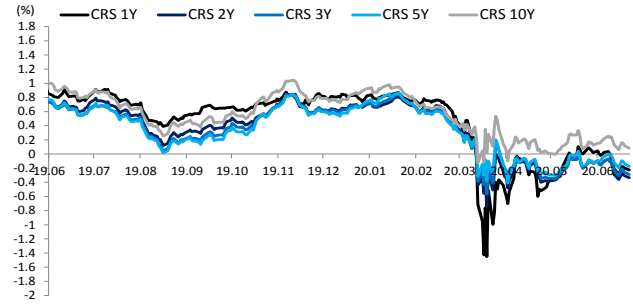
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



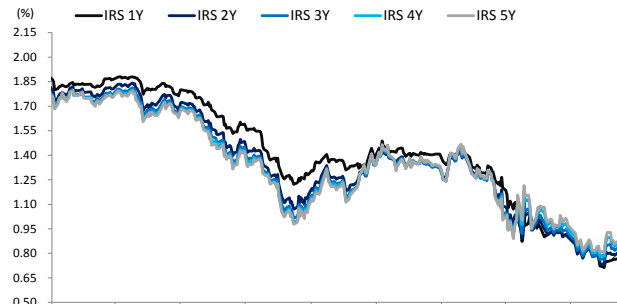
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



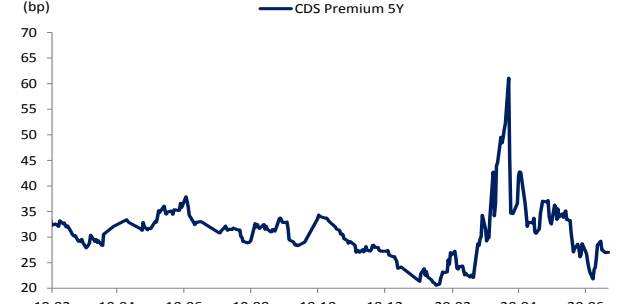
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



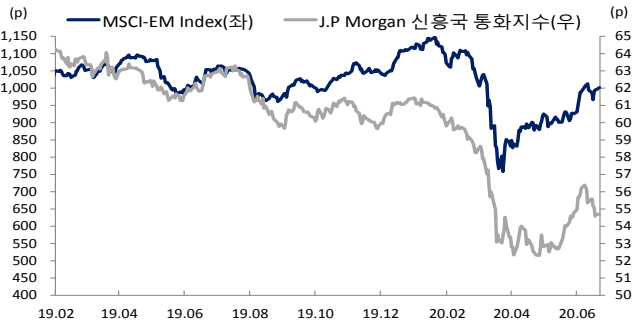
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



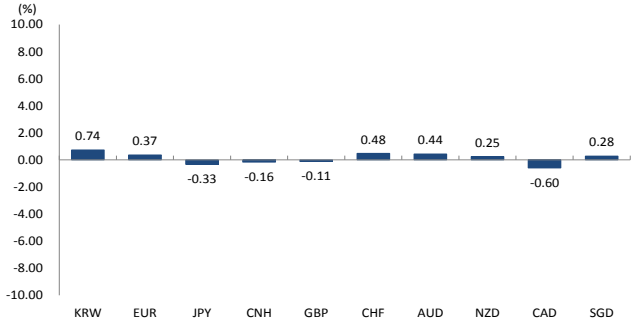
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



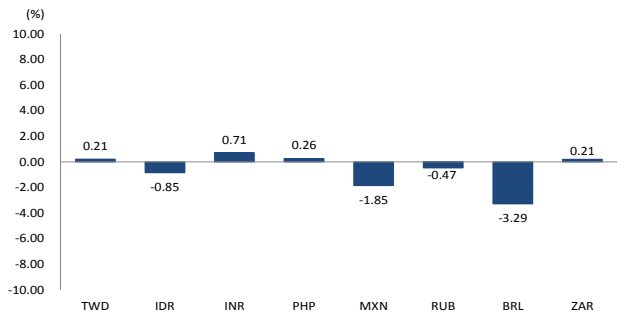
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

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.