

## FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

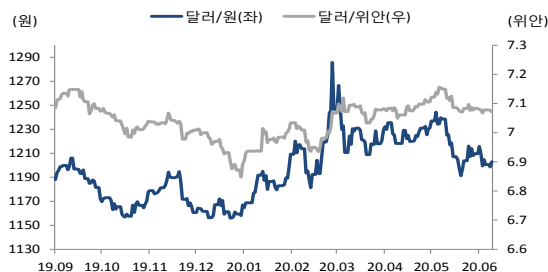
### ◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD007	1205.70	▲4.9	3.7	647,877
USD008	1205.20	▲4.7	3.7	79,247
USD/KRW	1205.70	▲4.8	3.4	
USD/CNY	7.0103	▼0.0029	0.0083	

### ◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	96.264	▼0.200	UST2Y	0.1570
EUR/USD	1.14	▲0.0056	UST10Y	0.6233
USD/JPY	107.24	▼0.0500	UST30Y	1.3109
GBP/USD	1.2553	▼0.0002	WTI	40.44

### 차트. 달러/위안 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

### 차트. 달러/인덱스 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

### 주요 경제지표 및 이벤트

전 일(07/14)	금 일(07/15)	익 일(07/16)
15:00 영국 5월 산업생산 MoM(결과:6.0%, 이전:-20.2%)	08:00 한국 6월 실업률(예상:4.5%, 이전:4.5%)	11:00 중국 6월 산업생산 YoY(예상:4.8%, 이전:4.4%)
15:00 영국 5월 제조업 생산 MoM(결과:8.4%, 이전:-24.4%)	09:30 호주 7월 웨스트팩 소비자신뢰지수(예상:-, 이전:6.3%)	11:00 중국 2분기 GDP QoQ(예상:2.2%, 이전:-6.8%)
15:00 독일 6월 CPI YoY(결과:0.9%, 잠정:0.9%)	15:00 영국 6월 CPI YoY(예상:0.4%, 이전:0.5%)	11:00 중국 6월 소매판매 YoY(예상:0.5%, 이전:-2.8%)
18:00 독일 7월 ZEW 서베이예상(결과:59.3, 이전:63.4)	15:00 영국 6월 소매물가지수 YoY(예상:1.1%, 이전:1.0%)	15:00 영국 5월 ILO 실업률 3M(예상:4.2%, 이전:3.9%)
19:00 미국 6월 NFIB 소기업 낙관지수(결과:100.6, 이전:94.4)	15:00 영국 5월 PPI YoY(예상:-1.1%, 이전:-1.4%)	20:45 유럽 ECB 통화정책회의 기준금리결정(예상:기준금리 동결)
21:30 미국 6월 CPI YoY(결과:0.6%, 이전:0.1%)	21:30 미국 7월 엔하이퍼스테이트 제조업(예상:8.4, 이전:-0.2)	21:30 미국 주간신규 실업수당청구건수(예상:1250k, 이전:1314k)
	22:15 미국 6월 산업생산MoM(예상:4.4%, 이전:1.4%)	21:30 미국 7월 필라델피아 연준 경기전망(예상:20.0, 이전:27.5)

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

## 트럼프의 대중 제재에도 위안화 강세

금일 달러/원 예상 : 1,201.00~1,207.00

NDF 최종호가 : 1,204.70/1,205.10(-0.65)

야간달러선물 종가 : 1,204.50원 | 고가:1,208.20원 | 저가:1,204.40원

### 전일 국내 동향

전일 대비 3.7원 오른 1204.6원에 개장한 환율은 글로벌 달러 강세 흐름과 위안화 환율이 약세를 나타내며 1200원 중반에서 좁은 폭 등락. 오후 들어 증시 외인 순매도 관련 커스터디 물량 유입과 WTI가격 하락에 환율은 완만한 상승세를 보임. 이후 좁은 폭 등락하다 전일 대비 4.8원 오른 1205.7원에 마감.

### 전일 해외 동향

달러화는 EU 정상회담을 앞두고 유럽연합 회복기금 합의에 대한 기대감으로 인한 유로화 강세와 뉴욕증시 강세에 하락.

유로화는 17일 유럽연합 정상회담에서 7500억 유로규모의 팬데믹 구제 패키지 합의 기대감에 전 저점 대비 0.8%가량 상승하며 유로당 1.141달러까지 상승. 한편 독일 7월 ZEW경기기대지수(59.3)는 예상치(60.0)과 이전치(63.4)를 하회. 독일 6월 CPI 최종치도 전년대비 0.9% 상승하며 잠정치와 일치.

뉴욕증시는 은행주들의 2분기 기업 실적의 희비가 엇갈렸지만, 주요 지수는 대체로 상승하여 달러화 약세에 일조. 산업과 에너지 등 경기순환 민감주가 큰폭 상승. 미국 6월 소비자물가지수는 전월대비 0.2%상승하며 각각 예상치(0.5%)와 이전치(-0.1%)를 상회. 전년대비 0.6%상승하여 이전치(0.1%)를 웃돌았음. CPI 상승의 원인은 유가 반등이 주요 원인이지만 코로나 발병 이전 수준인 2%대 레벨까지 미치지 못하는 상황. 미국 6월 NFIB소기업 낙관지수는 100.6으로 예상치(97.8)과 이전치(94.4)를 웃돌았음. 구리는 미중간 남중국해 영유권 문제로 갈등이 확산되며 상승세가 주춤.

### 금일 전망

금일 환율은 뉴욕 증시와 위안화 강세와 연동하여 하락 우위 속 좁은 폭 변동할 것으로 전망. 최근 뉴욕증시는 경기 지표에 반응하지 않고, 백신 개발과 코로나 확산세의 두가지 갈림길에서 제자리 걸음을 하는 양상. 다만 전일 주요기업의 호 실적과 부양책 기대감에 미 증시가 상승. 이에 외환 시장과 연동되는 우리 증시에 위험선호심리가 우세할 것으로 예상.

또한 미국 대선을 앞두고 남중국해 영유권 관련 분쟁, 미국의 홍콩 특별지위종료, 홍콩 국가보안법 제정관련 중국인 관료 제재 등 강한 압력을 넣고 있음. 그러나 역외 위안화는 달러당 7.0014위안까지 하락하는 등 강세 폭을 키우며 습관적인 트럼프 행정부의 대중 협박에 면역력이 생긴 모습. 이에 금일 환율은 EU정상회담을 대기하며 위안화와 우리 증시 연동하여 하락 우위 속 좁은 폭 변동을 예상.

## USD Futures &amp; Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD007	1,205.70	4.90	1,204.40	1,207.70	1,204.00	3.70	317,930	21,581	647,877	-7,170
USD008	1,205.20	4.70	1,203.80	1,207.40	1,203.70	3.70	29,146	8,452	79,247	29,056
USD SPOT	1,205.70	4.80	1,204.60	1,207.70	1,204.30	3.40	8,241	1,100	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	107,249	125,672	-18,423	-4,483	-69,953
은행	6,087	10,384	-4,297	27,327	25,883
투신	5,405	6,787	-1,382	-12,725	20,763
보험	13,489	13,519	-30	-2,185	-10,051
기타법인	8,133	9,806	-1,673	-6,060	6,937
개인	41,732	47,046	-5,314	-12,628	-11,421
외국인	215,661	184,542	31,119	-9,158	37,694

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,183.61	-2.45
국고채3Y	0.854	-0.006
국고채10Y	1.418	-0.002

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	25.434	0.249

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	50	-5,698	-20,179
KOSDAQ	-119	-882	-5,953
국고채	1,403	5,497	51,259
통안채	-364	10,328	27,238

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.17663	0.00188
Call	0.480	-0.100	3M	0.27088	-0.00412
CD	0.790	0.000	6M	0.34138	0.00213
통안1년	0.647	-0.001	12M	0.48100	-0.00025

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	26,642.59	556.79	2.13	2.91
S&P	3,197.52	42.30	1.34	1.66
나스닥	10,488.58	97.74	0.94	1.40
FTSE 100	6,179.75	3.56	0.06	-0.16
DAX 30	12,697.36	-102.61	-0.80	0.64
Nikkei 225	22,587.01	-197.73	-0.87	-0.12
Shanghai	3,414.62	-28.67	-0.83	2.07
항셍 H	10,405.27	-170.61	-1.61	-1.84
미국채 2년	0.16	0.01	4.04	0.19
미국채 10년	0.62	0.00	0.79	-2.56
WTI	40.44	0.34	0.85	-0.44
Gold	1,809.11	-0.74	-0.04	0.74

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	-0.15	0.00
3M	-0.85	-0.05
6M	-1.80	-0.10
12M	-4.50	0.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	-0.045	0.010
2Y	-0.135	0.005
3Y	-0.135	0.000
4Y	-0.095	0.000
5Y	-0.025	0.000

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화

\*영업일 기준으로 집계

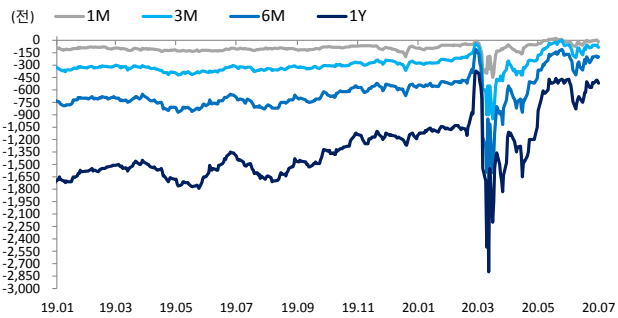
## 아시아 통화

## 기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	96.264	-0.200	-0.64	USD/KRW	1,205.75	5.10	0.84	USD/RUB	70.8689	-0.1160	-0.87
EUR/USD	1.1400	0.0056	1.12	USD/CNY	7.0058	0.0084	-0.11	USD/BRL	5.3685	-0.0376	-0.24
USD/JPY	107.24	-0.05	-0.26	USD/HKD	7.7514	0.0005	0.02	USD/ZAR	16.7505	-0.1054	-2.43
GBP/USD	1.2553	-0.0002	0.09	USD/SGD	1.3920	0.0015	-0.22	USD/MXN	22.4465	-0.3150	-1.79
USD/CHF	0.9400	-0.0016	-0.25	USD/TWD	29.536	0.015	0.17	USD/PLN	3.9252	-0.0355	-1.15
AUD/USD	0.6975	0.0035	0.40	USD/INR	75.43	0.24	0.66	USD/TRY	6.8652	0.0049	0.09
NZD/USD	0.6532	-0.0008	-0.21	USD/IDR	14,450	25	0.07	USD/SEK	9.1041	-0.0946	-1.73
USD/CAD	1.3615	0.0006	0.09	USD/THB	31.577	0.197	1.00	USD/NOK	9.4047	-0.0508	-0.91

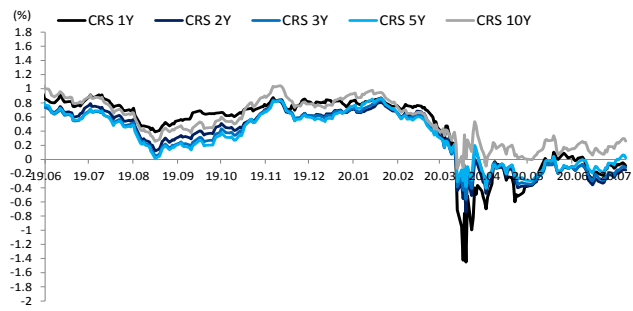
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



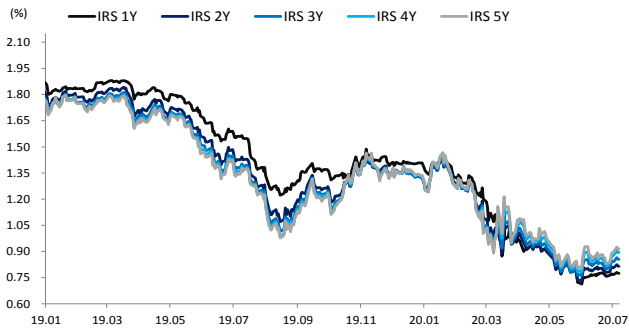
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



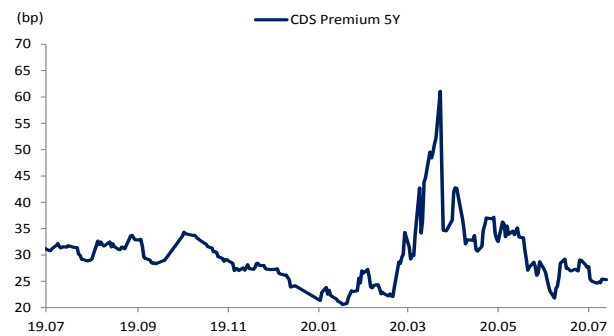
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



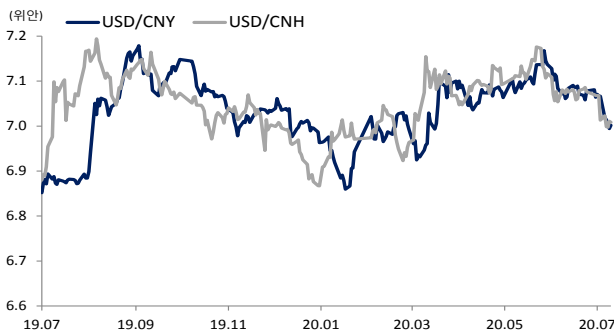
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



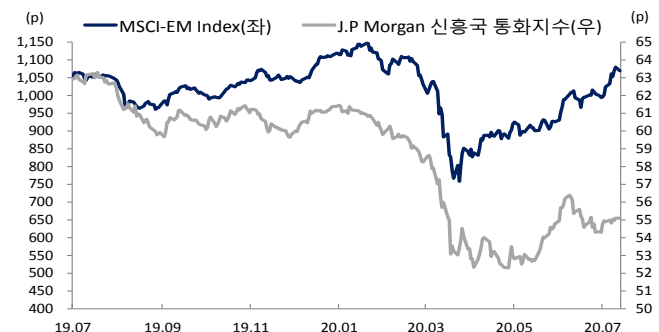
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



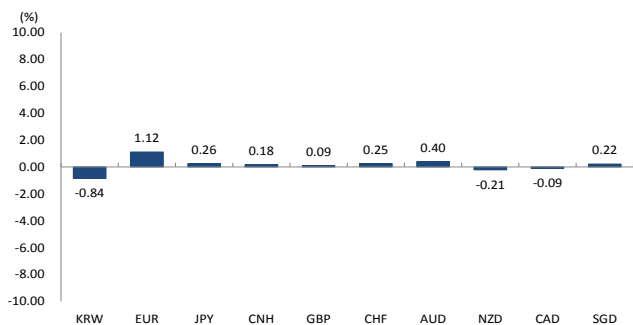
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



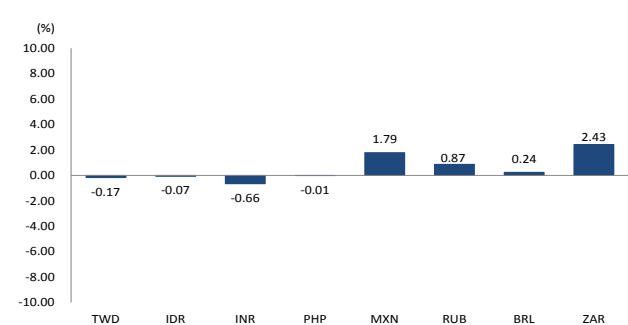
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 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.