

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

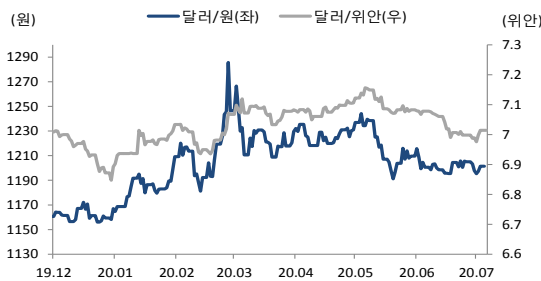
◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD008	1202.40	▲5.2	4.2	701,376
USD009	1201.80	▲4.9	3.8	1,853
USD/KRW	1201.50	▲4.2	4.1	
USD/CNY	7.0145	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

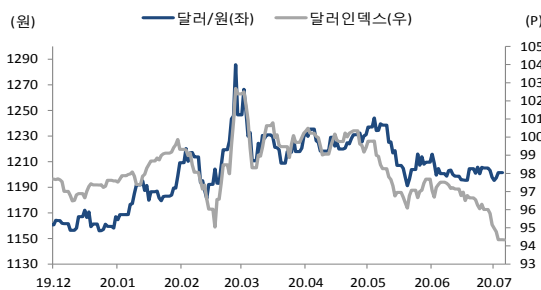
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	94.435	▼0.257	UST2Y	0.1473
EUR/USD	1.1656	▲0.0060	UST10Y	0.5888
USD/JPY	106.14	▼0.7200	UST30Y	1.2293
GBP/USD	1.2794	▲0.0053	WTI	41.29

차트. 달러/위안 & 달러/원



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 달러/인덱스 & 달러/원



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(07/24)	금 일(07/27)	익 일(07/28)
15:00 영국 6월 소매판매 MoM(결과:13.9%, 이전:12.3%)	10:30 중국 6월 산업생산 YoY(예상:--, 이전:6.0%)	22:00 미국 5월 케이스-실러 주택가격지수 YoY(예상:--, 이전:3.98%)
16:30 독일 7월 마켓 제조업 PMI(P)(결과:50.0, 이전:45.2)	17:00 유럽 6월 M3 통화공급 YoY(예상:9.3%, 이전:8.9%)	23:00 미국 7월 컨퍼런스보드 소비자지수(예상:94.8, 이전:98.1)
17:00 유럽 7월 마켓 제조업 PMI(P)(결과:51.1, 이전:47.4)	17:00 독일 7월 IFO기업경기지수(예상:89.3, 이전:86.2)	23:00 미국 7월 리치몬드 연방 제조업지수(예상:--, 이전:0%)
17:30 영국 7월 마켓 제조업 PMI(P)(결과:53.6, 이전:50.1)	21:30 미국 6월 내구재주문MoM(P)(예상:7.0%, 이전:15.7%)	
22:45 미국 7월 마켓 제조업 PMI(P)(결과:51.3, 이전:49.8)	23:30 미국 7월 달러스 연준 제조업 지수(예상:-4.9, 이전:-6.1)	
23:00 미국 6월 신규주택매매(결과:776k, 이전:682k)		(07/29)
		06:00 한국 7월 소비자심리지수(예상:--, 이전:81.8)

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

미중 갈등 격화 VS 달러화 약세

금일 달러/원 예상 : 1,197,00~1,203.00

NDF 최종호가 : 1,200.80/1,201.20(-0.15)

야간달러선물 종가 : 1,201.60원 | 고가:1,203.90원 | 저가:1,201.50원

전일 국내 동향

전일 대비 5.2원 오른 1202.5원에 개장한 환율은 장 초반 달러 약세 흐름 연동해 1199원까지 저점을 낮춤. 오후 들어 위안화 약세와 연동하여 상승 압력 있었으나 1200원대 초반에서 고점 매도물량 유입되어 상단이 제한. 좁은 폭 등락하다 1203.1원까지 고점을 높여 전일 대비 4.2원 오른 1201.5원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 미중 간 긴장감 고조, 미국 추가 경기부양책 연기, 미국 내 코로나19 확산으로 하락.

미국 공화당 미치 맥코넬 상원의원은 코로나 19 관련 추가 부양책 공개를 다음 주로 연기하였고 미국 내 코로나 확진자가 총 400만명을 넘어서며 불확실성 확대. 격화되는 미중 간 외교 갈등이 달러화 하락에 일조. 미중 양국이 대상국 주재 영사관 폐쇄 지시에 이어 미국 측은 중국의 미국에 대한 첩보활동이 수천 건에 달한다고 비난. 한 외신은 미 정부 요원들이 중국 휴스턴 영사관을 무단침입했다고 보도해 양국 갈등이 격화. 이에 역외 위안화는 달러 당 7.027위안까지 상승하며 약세 폭을 키움.글로벌 달러 약세에 금 현물은 2011년 이래 온스당 1900달러를 상향 돌파.

유로화는 유럽 경기 지표 반등에 강세폭을 키워 유로당 1.165달러까지 고점을 높임. 독일과 유럽, 영국 7월 마켓 제조업 PMI 잠정치는 각각 50.5, 51.1, 53.6으로 예상치 48.0, 50.1, 52.0를 웃돌음. 미국 경기지표는 엇갈렸는데 7월 미국 마켓 제조업 PMI 잠정치는 51.3으로 예상치(52.0)을 하회. 6월 신규주택매매는 77만6천건으로 예상치(70만 2천건) 웃돌음.

금일 전망

금일 환율은 역외 환율 반등에 하락 출발하겠으나 미중 간 격화되는 외교 긴장에 따른 위안화 약세에 연동해 상승 우위 속 좁은 폭 등락 할 것으로 전망. 2거래일 연속 하락한 뉴욕증시 약세에 연동한 증시 외인 매도 관련 역송금 물량 출회 가능성도 상승세에 힘을 실을 것.

다만 미국의 대내외 정치적 갈등이 확산되고 있고, 전 거래일 발표한 유럽경기 지표가 증명하듯 상대적으로 긍정적인 유럽 경기가 달러화 약세 요인으로 작용해 상단이 제한될 것으로 전망. 금주 29일 예정된 미국 FOMC회의에서 장기금리 저금리 기조 유지와 완화된 포워드 가이드를 언급할 것으로 예상되는 점도 달러 매도 요인.달러/원 200일 150일 이동선이 1200원대 초반 박스권에 몰려 있어 상승 우위 속 상 하단 제한될 것으로 예상.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD008	1,202.40	5.20	1,201.50	1,202.90	1,198.70	4.20	285,297	-16,304	701,376	1,075
USD009	1,201.80	4.90	1,201.80	1,202.50	1,198.70	3.80	2,475	975	1,853	231
USD SPOT	1,201.50	4.20	1,202.50	1,203.10	1,199.00	4.10	7,077	864	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	77,246	76,325	921	-14,845	-26,821
은행	1,723	486	1,237	9,742	34,793
투신	591	4,816	-4,225	765	-18,233
보험	20	487	-467	-1,725	-12,021
기타법인	8,706	11,874	-3,168	5,611	9,537
개인	25,824	28,435	-2,611	4,970	-13,412
외국인	173,992	165,679	8,313	-4,518	25,861

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,200.44	-15.75
국고채3Y	0.799	0.001
국고채10Y	1.305	-0.013

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	24.207	-0.040

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	876	2,522	-11,828
KOSDAQ	-1,245	-189	-2,375
국고채	1,922	10,268	31,109
통안채	700	4,410	26,583

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.17263	0.00100
Call	0.480	-0.050	3M	0.24675	0.00225
CD	0.780	0.000	6M	0.31850	-0.00663
통안1년	0.605	-0.002	12M	0.45950	-0.00263

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	26,469.89	-182.44	-0.68	-0.76
S&P	3,215.63	-20.03	-0.62	-0.28
나스닥	10,363.18	-98.24	-0.94	-1.33
FTSE 100	6,123.82	-87.62	-1.41	-2.65
DAX 30	12,838.06	-265.33	-2.02	-0.63
Nikkei 225	22,751.61	-132.61	-0.58	-0.85
Shanghai	3,196.77	-128.34	-3.86	-0.54
항셱 H	10,080.86	-244.39	-2.37	-1.20
미국채 2년	0.15	-0.00	-2.64	1.52
미국채 10년	0.59	0.01	1.97	-6.03
WTI	41.29	0.22	0.54	1.72
Gold	1,893.86	28.64	1.54	5.14

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	-0.35	-0.05
3M	-1.05	0.00
6M	-2.20	-0.10
12M	-4.60	0.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	-0.065	-0.010
2Y	-0.115	-0.015
3Y	-0.110	-0.025
4Y	-0.065	-0.025
5Y	-0.015	-0.030

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화

*영업일 기준으로 집계

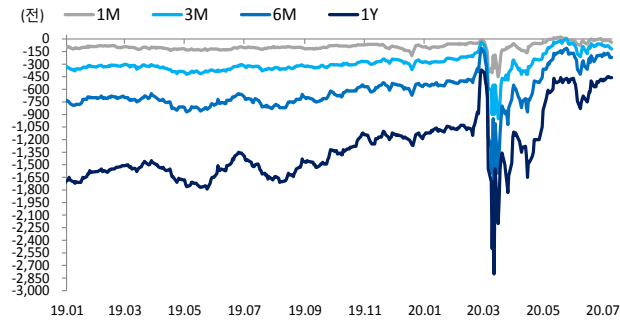
아시아 통화

기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	94.435	-0.257	-1.57	USD/KRW	1,201.45	4.05	-0.30	USD/RUB	71.7352	0.2664	-0.22
EUR/USD	1.1656	0.0060	2.00	USD/CNY	7.0184	0.0143	0.37	USD/BRL	5.2324	0.0182	-2.86
USD/JPY	106.14	-0.72	-0.82	USD/HKD	7.7513	0.0002	-0.03	USD/ZAR	16.6574	-0.0078	-0.22
GBP/USD	1.2794	0.0053	1.80	USD/SGD	1.3824	-0.0036	-0.56	USD/MXN	22.2828	-0.2356	-1.18
USD/CHF	0.9206	-0.0048	-1.92	USD/TWD	29.500	0.022	-0.09	USD/PLN	3.7795	-0.0236	-3.52
AUD/USD	0.7105	0.0007	1.56	USD/INR	74.83	0.06	-0.26	USD/TRY	6.8464	0.0023	-0.25
NZD/USD	0.6641	0.0006	1.28	USD/IDR	14,610	30	-0.63	USD/SEK	8.8387	-0.0241	-2.17
USD/CAD	1.3415	0.0005	-1.22	USD/THB	31.698	0.005	-0.07	USD/NOK	9.1529	-0.0744	-1.51

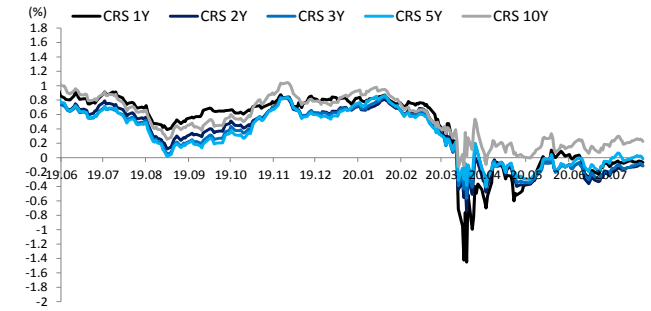
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



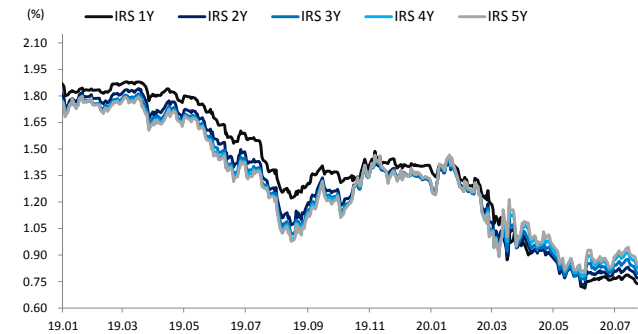
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



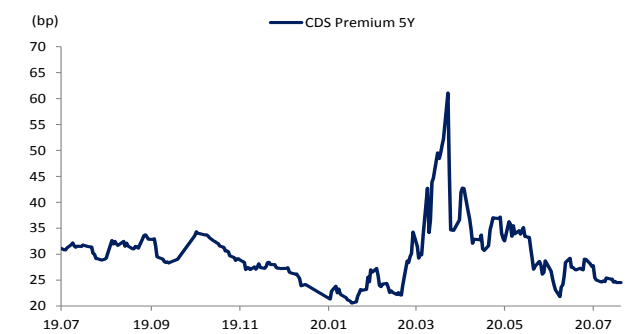
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



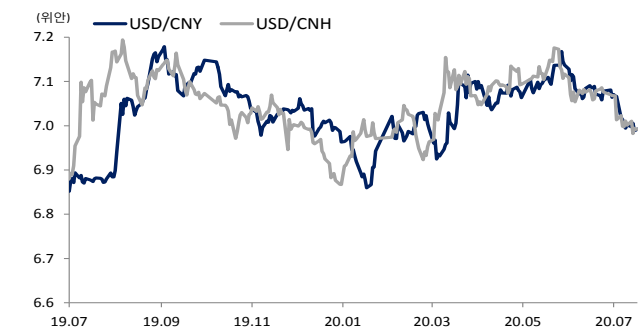
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



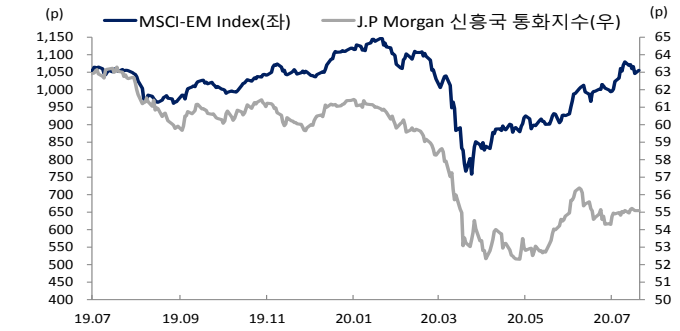
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



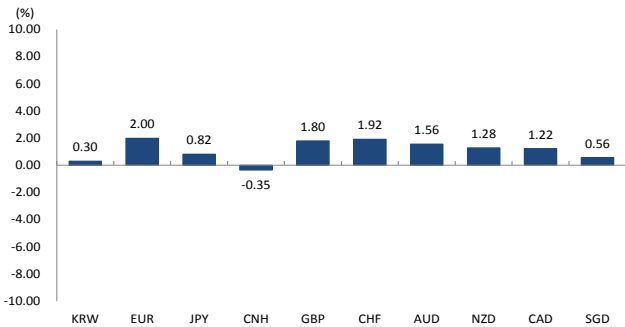
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



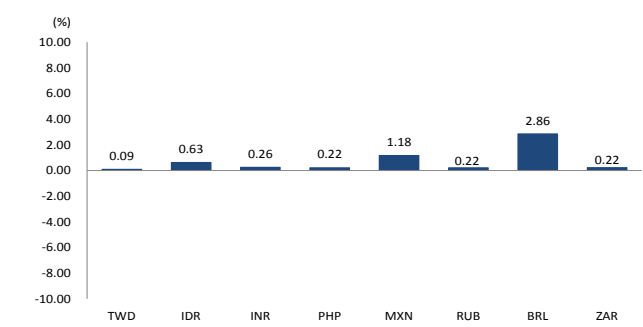
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

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.