

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

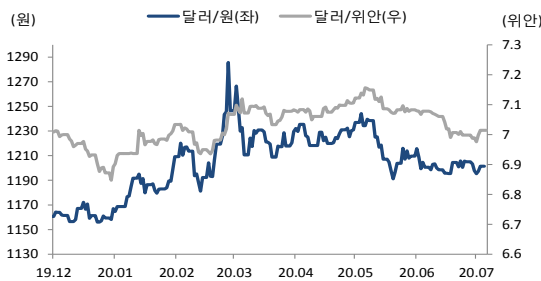
◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD008	1195.50	▼6.9	7.7	731,104
USD009	1195.90	▼5.9	6.8	2,449
USD/KRW	1196.10	▼5.4	7	
USD/CNY	7.0016	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

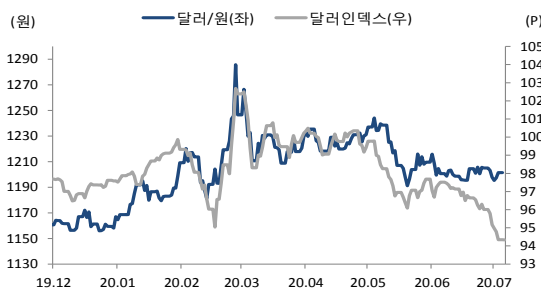
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	94.435	▼0.257	UST2Y	0.1514
EUR/USD	1.1656	▲0.0060	UST10Y	0.6151
USD/JPY	106.14	▼0.7200	UST30Y	1.2601
GBP/USD	1.2794	▲0.0053	WTI	41.60

차트. 달러/위안 & 달러/원



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 달러/인덱스 & 달러/원



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(07/27)	금 일(07/28)	익 일(07/29)
17:00 유럽 6월 M3 통화공급 YoY(결과:9.2%, 이전:8.9%)	22:00 미국 5월 케이스-실러 주택가격지수 YoY(예상:--, 이전:3.98%)	10:30 호주 2분기 CPI YoY(예상:-0.5%, 이전:2.2%)
17:00 독일 7월 IFO기업경기지수(결과:90.5, 이전:86.3)	23:00 미국 7월 컨퍼런스보드 소비자대지수(예상:94.4, 이전:98.1)	15:45 프랑스 7월 소비자대지수(예상:99, 이전:97)
21:30 미국 6월 내구재주문MoM(P)(결과:7.3%, 이전:15.1%)	23:00 미국 7월 리치몬드 연방 제조업지수(예상:--, 이전:0)	21:30 미국 6월 도매재고 MoM(P)(예상:-0.3%, 이전:-1.2%)
23:30 미국 7월 달러스 연준 제조업 지수(결과:-3.0, 이전:-6.1)		23:30 미국 DOE 주간원유재고(예상:--, 이전:4892k)
	(07/29)	(07/30)
	06:00 한국 7월 소비자심리지수(예상:--, 이전:81.8)	03:00 미국 FOMC 통화정책회의 기준금리 결정(예상:동결)

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

킹달러 지위 강등, 달러패권 흔들릴까

금일 달러/원 예상 : 1,193,00~1,200.00

NDF 최종호가 : 1,195.60/1,196.00(-0.05)

야간달러선물 종가 : 1,196.00원 | 고가:1,197.80원 | 저가:1,195.10원

전일 국내 동향

전일 대비 0.3원 내린 1201.2원에 개장한 환율은 미중 간 외교 갈등에도 외인 증시 순매수세 유입과 역외 달러 매도세에 1194.5원까지 저점을 낮춤. 오후 들어 글로벌 달러 약세 흐름 지속되며 하방 압력 있었지만 수입업체 결제 수요에 추가 하락이 제한돼 전일 대비 5.4원 내린 1196.1원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 29일 예정된 FOMC 회의를 앞두고 연준의 완화적 통화정책 시행 기대감과 유로화 강세, 미국 내 우려스러운 코로나19 확산세에 하락.

다가오는 FOMC 통화정책 회의에서 연준이 공격적인 비둘기적 논조를 내비출 것이라는 예상과 기준금리를 제로부근에서 장기간 유지할 것으로 기대. 장기 채권 매입 규모 확대와 수익률 곡선 제어정책 시행 여부도 논의될 것으로 예상되며 실질금리가 마이너스까지 하락. 이에 달러화는 93.47까지 저점을 낮춤.

이에 더해 미국에서 코로나 19로 인한 하루 사망자가 5일 연속 1천명을 넘어서는 등 확산세가 이어지고 있는 점이 안전자산으로서 달러화 지위를 끌어내리고 있음. 플로리다 누적 확진자는 42만 3천여명을 기록해 뉴욕주(40만 1천여명)를 앞섰으며, 확진자수가 가장 많은 캘리포니아(45만 3천명)를 뒤임. 달러화 약세 압력에 달러화를 대체할 안전자산으로서 금 현물은 온스당 1943달러까지 상승.

금일 전망

금일 환율은 달러화 하방 압력과 외인 증시 순매수세에 대한 기대감에 하락 압력이 우위를 보일 것으로 전망.

전일 환율은 글로벌 달러화 약세 흐름에 연동하여 하락 우위의 흐름을 나타냄. 최근 달러화는 안전자산으로서 지위가 희석된 모습. 미국 내에서 급증하는 코로나 확산세에도 단행되는 술집 영업과 학기 재개로 인한 우려감, FOMC에서의 불가피한 완화정책 시행 가능성으로 미국 실질금리가 마이너스 영역까지 하락. 반면 유럽 국가의 경우 유럽연합경기회복기금 승인에 이어 팬데믹 확산을 막기 위한 선제적 통제가 이뤄지고 있음. 이에 안전자산으로서 상대적 달러화의 투자 가치가 감소해 달러화 숏 베팅 가능성 있음. 이에 더해 전일 뉴욕증시 반등에 연동하여 2거래일 연속 약 1600억원 순매수한 외인 증시 순매수세 이어지질 수 있는 점, 미중 갈등 발 리스크오프 심리가 둔화돼 위안화가 7위안을 하회한 점이 추가 환율 하락 요인으로 작용할 것으로 예상.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD008	1,195.50	-6.90	1,202.00	1,202.00	1,194.30	7.70	285,377	80	731,104	29,728
USD009	1,195.90	-5.90	1,201.00	1,201.00	1,194.20	6.80	2,420	-55	2,449	596
USD SPOT	1,196.10	-5.40	1,201.20	1,201.50	1,194.50	7.00	5,717	-1,360	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	89,730	55,652	34,078	5,590	-6,381
은행	6,639	838	5,801	16,008	39,685
투신	6,375	1,500	4,875	6,103	-16,522
보험	68	39	29	-1,413	-12,111
기타법인	12,887	10,813	2,074	5,468	8,418
개인	29,783	25,121	4,662	3,230	-13,280
외국인	142,614	194,133	-51,519	-34,986	-5

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,217.86	17.42
국고채3Y	0.803	0.004
국고채10Y	1.304	-0.001

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	23.841	-0.130

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	1,584	4,859	-7,958
KOSDAQ	824	1,589	-582
국고채	932	9,706	30,125
통안채	5,498	7,411	30,683

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.16625	-0.00638
Call	0.460	-0.060	3M	0.26963	0.02288
CD	0.780	0.000	6M	0.31663	-0.00187
통안1년	0.606	0.001	12M	0.45688	-0.00262

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	26,584.77	114.88	0.43	-0.36
S&P	3,239.41	23.78	0.74	-0.38
나스닥	10,536.27	173.09	1.67	-2.14
FTSE 100	6,104.88	-18.94	-0.31	-2.50
DAX 30	12,838.66	0.60	0.00	-1.60
Nikkei 225	22,715.85	-35.76	-0.16	-0.24
Shanghai	3,205.23	8.46	0.26	-3.29
항셱 H	10,075.45	-5.41	-0.05	-2.14
미국채 2년	0.15	0.00	2.78	2.85
미국채 10년	0.62	0.03	4.47	0.80
WTI	41.60	0.31	0.75	1.94
Gold	1,935.18	33.16	1.74	6.55

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	-0.25	0.10
3M	-0.85	0.20
6M	-2.00	0.20
12M	-4.20	0.40

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	-0.040	0.025
2Y	-0.095	0.020
3Y	-0.090	0.020
4Y	-0.035	0.030
5Y	0.015	0.030

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화

*영업일 기준으로 집계

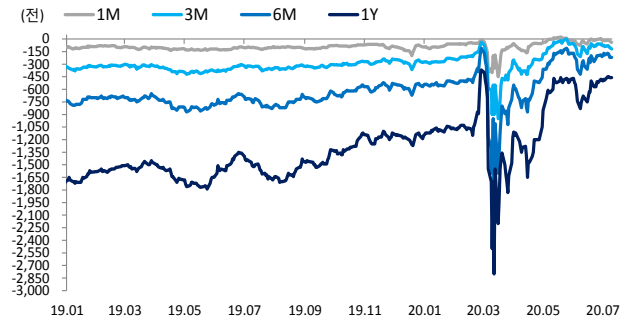
아시아 통화

기타 통화

종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.648	-0.787	-2.28	USD/KRW	1,196.15	-5.30	-0.59	USD/RUB	71.6097	-0.1255	0.36
EUR/USD	1.1752	0.0096	2.66	USD/CNY	6.9964	-0.0220	0.18	USD/BRL	5.1506	-0.0818	-3.43
USD/JPY	105.37	-0.77	-1.77	USD/HKD	7.7515	0.0002	-0.01	USD/ZAR	16.4249	-0.2325	-1.28
GBP/USD	1.2882	0.0088	1.75	USD/SGD	1.3787	-0.0037	-0.73	USD/MXN	21.9229	-0.3599	-2.53
USD/CHF	0.9199	-0.0007	-2.02	USD/TWD	29.420	-0.080	-0.35	USD/PLN	3.7362	-0.0433	-4.02
AUD/USD	0.7149	0.0044	1.90	USD/INR	74.84	0.01	-0.11	USD/TRY	6.8700	0.0236	0.17
NZD/USD	0.6684	0.0043	1.63	USD/IDR	14,535	-75	-1.69	USD/SEK	8.7336	-0.1051	-2.66
USD/CAD	1.3356	-0.0059	-1.32	USD/THB	31.698	0.005	-0.07	USD/NOK	9.0944	-0.0585	-1.46

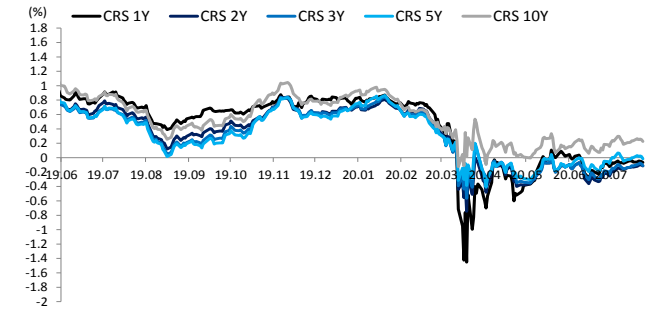
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



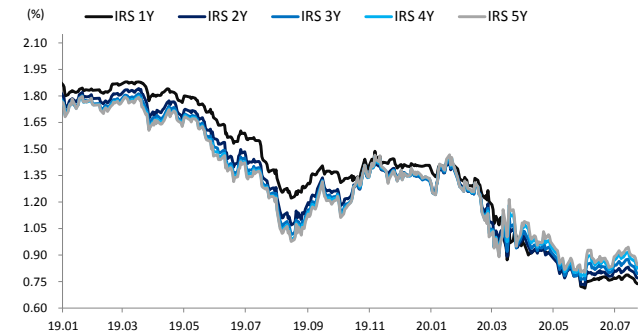
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



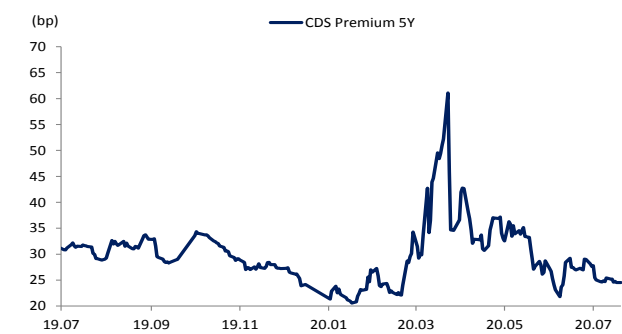
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



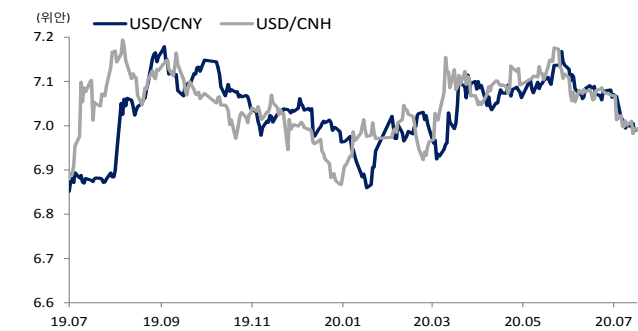
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



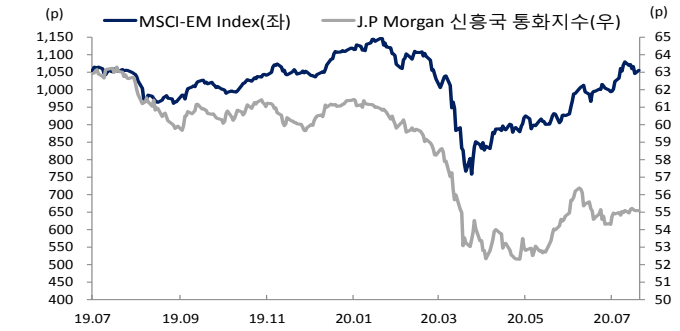
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



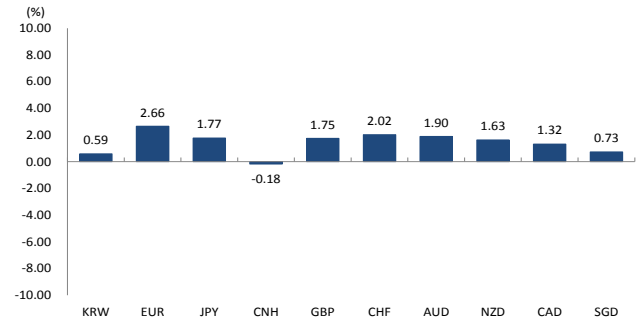
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



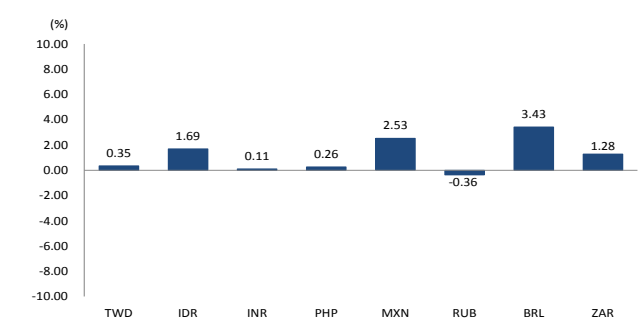
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

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.