

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD008	1193.80	▼4.0	5.9	721,783
USD009	1192.80	▼3.9	5.0	4,178
USD/KRW	1193.10	▼3.8	5.4	
USD/CNY	7.0025	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.291	▼0.405	UST2Y	0.1309
EUR/USD	1.1792	▲0.0076	UST10Y	0.5741
USD/JPY	104.92	▼0.1700	UST30Y	1.2362
GBP/USD	1.2997	▲0.0065	WTI	41.32

차트. 달러/위안 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. 달러/인덱스 & 달러/원



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(07/29)		금 일(07/30)		의 일(07/31)	
15:45 프랑스 7월 소비자기대지수(결과:94, 이전:96)		17:00 독일 2분기 GDP QoQ(P)(예상:-9.0%, 이전:-2.2%)		10:30 호주 2분기 PPI YoY(예상:--, 이전:1.3%)	
21:30 미국 6월 도매재고 MoM(P)(결과:-2.0%, 이전:-1.2%)		18:00 유럽 7월 소비자기대지수(F)(예상:--, 잠정:-15.0)		14:30 프랑스 2분기 GDP QoQ(P)(예상:-15.2%, 이전:-5.3%)	
23:30 미국 DOE 주간원유재고(결과:-10611k, 이전:4892k)		21:00 독일 7월 CPI YoY(P)(예상:0.1%, 이전:0.9%)		18:00 유럽 7월 CPI YoY(예상:0.2%, 이전:0.3%)	
(07/30)		21:30 미국 2분기 GDP QoQ(예상:-34.8%, 이전:-5.0%)		21:30 미국 6월 개인소득MoM(예상:-0.7%, 이전:-4.2%)	
03:00 미국 FOMC 통화정책회의 기준금리 결정(결과:동결)		21:30 미국 2분기 개인소비지출(예상:-34.5%, 이전:-6.8%)		21:30 미국 7월 미시간대 소비자신뢰지수(F)(예상:72.8, 잠정:73.2)	

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

비둘기연준, 고용지표 발표 대기

금일 달러/원 예상 : 1,188.00~1,195.00

NDF 최종호가 : 1,191.60/1,191.90(-1.25)

야간달러선물 종가 : 1,191.00원 | 고가:1,194.20원 | 저가:1,189.90원

전일 국내 동향

전일 대비 0.2원 오른 1197.1원에 개장한 환율은 장 초반 1190원대 중반에서 등락하다 달러 매도 물량과 월말 네고로 추정되는 물량이 유입되며 하락. 오후에도 코스피 외인 순매수세가 이어져 환율은 낙폭을 키워 1192.8원까지 저점 을 낮춤. 이에 전일 대비 3.8원 내린 1193.1원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 FOMC 회의에서 연준 위원들이 만장일치로 기준금리를 제로수준 (0% ~ 0.25%)으로 동결하고 경기반등을 위해 모든 정책도구를 사용할 것이라는 성명 발표에 하락. FOMC 회의에서 미국채와 기관의 주택 및 상업용 MBS보유를 최소한 현재의 속도로 확대시키겠다 언급. 이번 성명서가 6월 성명서와 다른 점은 경제의 경로가 바이러스의 진로에 크게 좌우될 것이라는 문구를 새로 삽입. 파월 의장은 기자회견에서 경기회복을 위해서 재정정책과 통화정책의 지원이 필요하고, 현재 의회에서 협상 중인 1조 달러 규모의 추가 부양책을 지지한다 언급. 연준의 비둘기적 성명서에 뉴욕증시는 오름폭을 키웠고, 미국채 5년물 금리는 1.26bp 내린 0.2516%로 사상 최저치를 경신. 명목 금리에서 기대 인플레이션을 뺀 미국채 10년물 실질금리는 마이너스 영역 (-0.93%)까지 하락하며 달러화 약세에 일조. 미국 코로나 19 사망자수가 15만 명을 넘어서고, 7일간 일평균 사망자도 1000만명을 웃돈다. 달러화는 낙폭을 키워 93.17까지 저점을 낮춤.

금일 전망

금일 환율은 연준의 완화적 정책 기조에 따른 달러화 약세 흐름과 뉴욕증시 강세가 아시아 증시에 우호적 환경을 제공해 환율 하방 우위를 전망.

미국 추가 부양책 지원 법안이 여전히 합의점을 찾지 못한 가운데, 미국 내에서는 팬데믹 확산세가 지속되고 있음. 금일 발표 예정인 미국 주간 신규실업수당 청구건수가 예상치를 웃돌아 시장을 실망시킬 수 있을 가능성은 달러 매도 포지션 배팅을 유도. 이에 더해 전일 FOMC 회의에서 연준이 팬데믹의 심각성을 언급하며 자산매입 기조를 유지할 것이라 강조. 이 점도 미국 고용지표 결과가 부진할 경우 중앙은행의 자산매입 가능성에 힘을 실어 달러화 하방 우위 흐름에 따른 원달러 강세요인으로 작용. 이에 1900원 하향 이탈 시도 주시. 한편 연준이 한국과 멕시코 등 중앙은행과 통화스왑 계약의 만료 시기를 내년 3월 31일 까지 연장을 발표.

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD008	1,193.80	-4.00	1,198.00	1,198.80	1,192.90	5.90	256,584	-144,472	721,783	9,894
USD009	1,192.80	-3.90	1,196.10	1,197.80	1,192.80	5.00	1,148	-3,831	4,178	448
USD SPOT	1,193.10	-3.80	1,197.10	1,198.20	1,192.80	5.40	8,018	-46	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	84,887	68,100	16,787	-11,410	4,716
은행	1,659	1,420	239	14,948	50,359
투신	381	965	-584	-3,414	-15,014
보험	13	260	-247	-826	-10,533
기타법인	11,734	9,029	2,705	325	7,200
개인	30,099	19,486	10,613	4,515	-3,885
외국인	129,156	158,659	-29,503	-4,128	-36,629

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,263.16	6.17
국고채3Y	0.811	-0.002
국고채10Y	1.309	-0.020

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	23.664	-0.154

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	2,936	16,417	10,395
KOSDAQ	747	730	-532
국고채	-125	7,301	28,731
통안채	-712	6,280	29,571

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.16113	-0.00575
Call	0.530	0.050	3M	0.26063	-0.00762
CD	0.780	0.000	6M	0.31550	-0.00200
통안1년	0.609	-0.002	12M	0.46113	0.00063

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	26,539.57	160.29	0.61	-1.73
S&P	3,258.44	40.00	1.24	-0.54
나스닥	10,542.94	140.85	1.35	-1.52
FTSE 100	6,131.46	2.20	0.04	-1.22
DAX 30	12,822.26	-13.02	-0.10	-2.15
Nikkei 225	22,397.11	-260.27	-1.15	-1.41
Shanghai	3,294.55	66.59	2.06	-1.16
항셍 H	10,184.41	32.52	0.32	-0.58
미국채 2년	0.13	-0.01	-5.62	-12.27
미국채 10년	0.57	-0.00	-0.85	-3.85
WTI	41.32	0.28	0.68	-1.38
Gold	1,960.35	13.36	0.69	5.10

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	-0.10	0.05
3M	-0.60	0.10
6M	-1.60	0.20
12M	-3.80	0.20

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	-0.015	-0.005
2Y	-0.065	-0.010
3Y	-0.060	-0.015
4Y	-0.020	-0.025
5Y	0.030	-0.025

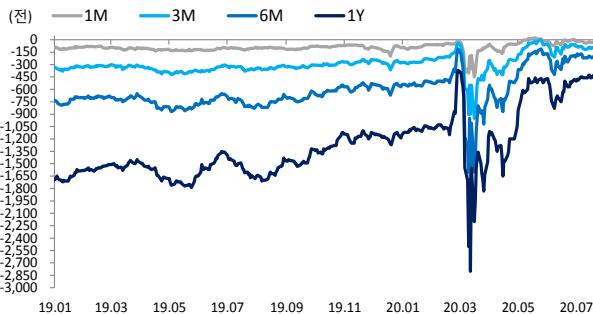
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.291	-0.405	-1.79	USD/KRW	1,193.10	-3.95	-0.17	USD/RUB	72.5819	-0.0081	2.11
EUR/USD	1.1792	0.0076	1.92	USD/CNY	7.0016	0.0008	0.02	USD/BRL	5.1695	0.0125	1.00
USD/JPY	104.92	-0.17	-2.08	USD/HKD	7.7501	-0.0002	-0.03	USD/ZAR	16.5423	0.0197	0.35
GBP/USD	1.2997	0.0065	2.07	USD/SGD	1.3737	-0.0053	-0.86	USD/MXN	21.9737	0.0369	-1.76
USD/CHF	0.9126	-0.0053	-1.83	USD/TWD	29.385	0.008	-0.30	USD/PLN	3.7363	-0.0299	-2.24
AUD/USD	0.7188	0.0030	0.67	USD/INR	74.80	-0.05	0.05	USD/TRY	6.9784	0.0432	1.86
NZD/USD	0.6669	0.0008	0.11	USD>IDR	14,543	8	-0.73	USD/SEK	8.7219	-0.0516	-1.61
USD/CAD	1.3340	-0.0040	-0.57	USD/THB	31.445	-0.253	-0.63	USD/NOK	9.0282	-0.0910	-0.79

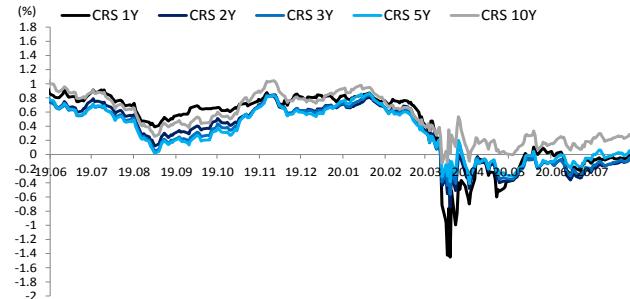
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



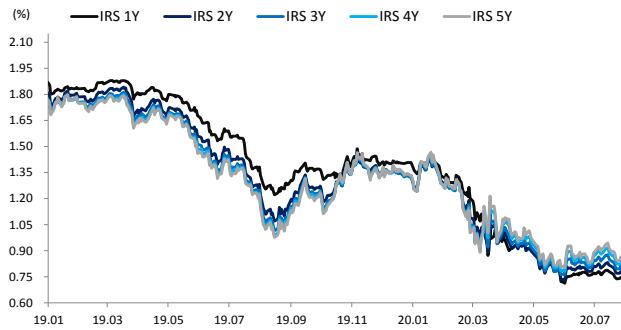
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



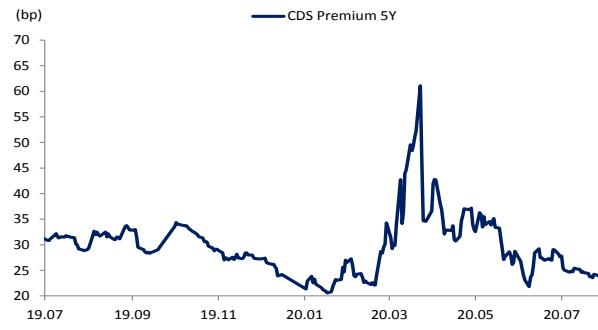
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



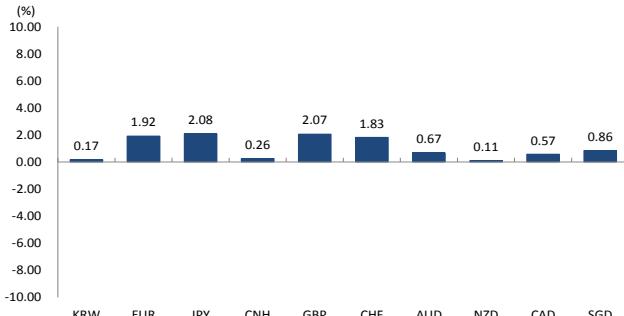
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



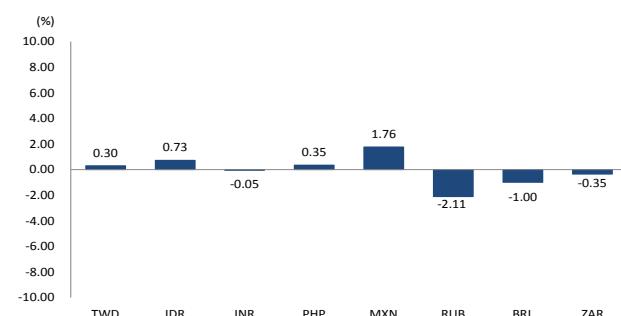
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터