

Futures / FX Daily

해외투자영업부
2018.09.07 (금)

[24hr DESK: 1577-1282]

I . Global Market / 글로벌 마켓

주요국 주가지수

구분	전일종가	전일비(%)	1wk(%)	YTD(%)
미국 DOW	25,995.87	0.08	-0.49	5.16
미국 NASDAQ	7,922.73	-0.91	-2.31	14.77
미국 S&P500	2,878.05	-0.37	-1.24	7.65
영국 FTSE	7,318.96	-0.87	-2.62	-4.80
DJ Euro STOXX 50	3,295.95	-0.59	-3.94	-5.94
일본 NIKKEI	22,487.94	-0.41	-1.67	-1.22
홍콩 Hang Seng	26,974.82	-0.99	-4.22	-9.84
KOSPI	2,287.61	-0.18	-0.86	-7.29

Market Review

■ 글로벌 증시 - 뉴욕증시, 무역분쟁 우려, 기술주 급락에 혼조

뉴욕증시가 혼조세를 보였다. 미중간 무역분쟁에 대한 우려가 지속되는 가운데 기술주가 급락세를 보이면서다. 6일(현지시간) 기술주 중심의 나스닥종합지수는 전일 대비 72.45포인트(0.9%) 하락한 7922.73으로 마감했다. 3거래일 연속 하락했다. 시가총액 1위 애플과 아마존은 각각 1.7%, 1.8% 급락했다. S&P500지수는 전일 대비 10.55포인트(0.4%) 떨어진 2878.05로 장을 끝냈다. 에너지(-1.9%)와 기술업종(-0.8%)이 지수 하락을 주도했다. 다우존스산업평균지수는 전일 대비 20.88포인트(0.1%) 오른 2만5995.87로 거래를 마쳤다.

기술주 중에서도 반도체주의 하락폭이 컸다. 마이크론테크놀로지는 10%나 추락했다. 램 리서치와 어플라이드 매터리얼즈는 각각 6.7%, 5.3% 떨어졌다. 모건스탠리는 가격압박과 재고부담을 증가하고 있다며 반도체시장의 펀더멘털이 악화되고 있다고 경고한 이후 반도체주는 급락세를 보였다. 기술업종은 울들어서만 16% 이상 상승하며, 시장수익률을 상회하고 있다. 하지만 기술업종은 이번주 들어 2% 이상 떨어지는 등 급락세를 보이고 있다.

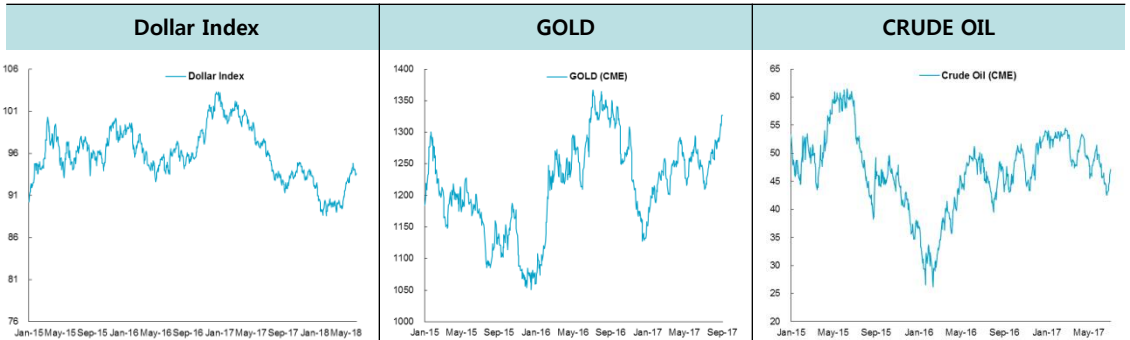
미중간 무역분쟁 우려는 여전히 투자심리를 압박했다. 앞서 블룸버그 뉴스가 지난주 트럼프 대통령이 2000억 달러규모의 중국산 제품에 대한 관세부과 계획을 이번 주에 강행하기를 원한다고 보도한 이후 투자자들은 관망세를 유지하고 있다. 중국 상무부는 미국이 새로운 관세를 부과할 경우 보복관세로 대응할 것이라고 밝혔다. 2000억 달러 관세부과계획에 대한 트럼프 행정부의 의견수렴기간은 이날로 마무리될 예정이다.

이날 뉴욕외환시장에서 주요 6개국 통화에 대한 달러가치를 보여주는 미국 달러 인덱스는 전일대비 0.1% 하락한 95.02을 기록했다. 고용지표 부진이 달러 약세를 이끌었다. ADP의 8월 민간부문 취업자 수는 16만3000명으로 시장 전망치를 하회했다.

II . Futures / 해외선물

전일 상품가격

구분	전일증가	전일비(%)	시가	고가	저가
Crude Oil	67.77	-1.38	68.64	69.02	67.00
N.Gas	2.772	-0.82	2.793	2.797	2.765
Gold	1,204.3	0.25	1,202.5	1,212.7	1,200.5
H-G Bopper	263.7	1.02	262.0	267.2	261.1
Corn	366.25	0.27	365.50	367.75	363.50
Wheat	513.75	-1.53	522.00	524.50	512.50
Soybean	839.25	0.15	838.25	842.75	834.75



(자료: Bloomberg, 한국투자증권)

Market Review

■ Energy – 국제유가, 미국 석유제품 재고 증가에 하락

뉴욕 유가는 미국의 휘발유 등 석유제품 재고가 증가한 점이 부각되면서 하락했다. 원유시장 참가자들은 미국의 원유재고 지표와 미국의 중국에 대한 추가 관세 부과 여부, 신형시장 불안 등을 주시했다. 이날 발표된 미국 원유재고는 시장 예상보다 큰 폭 줄었지만, 휘발유와 정제유 등 다른 석유제품 재고가 증가한 점이 더 부각됐다. 미 에너지정보청(EIA)은 지난주 미국 원유재고가 약 430만 배럴 감소했다고 밝혔다. 월스트리트저널(WSJ)에 따르면 전문가들은 원유재고가 전주 대비 210만 배럴 줄었을 것으로 봤다. 원유재고가 줄었지만, 휘발유와 정제유를 합한 재고가 500만 배럴 가까이 증가했다. EIA에 따르면 원유와 휘발유, 정제유는 물론 에탄올 등을 모 두합친 총재고는 360만 배럴 증가했다. 미국 원유 수출이 감소세를 보인 점도 유가 하락 압력을 가중했다. EIA는 지난주 원유 수출이 하루 평균 27만1천 배럴 줄어 150만 배럴을 기록했다고 밝혔다.

■ Precious Metal –금, 달러 강세 주춤하며 상승

뉴욕 금 가격은 고용 관련 지표 부진에 따른 달러 약세로 0.3% 상승했다. 이날 민간고용업체인 ADP가 발표한 전미 고용보고서에 따르면 8월 민간부문 고용이 16만3천 건 증가한 것으로 확인됐다. 이는 전문가 예상보다 낮은 수치다. 이에 따라 다음날 발표될 8월 고용지표에 대한 기대를 낮추며 달러를 끌어 내렸다. 전문가들은 이날 숏커버링이 늘어나며 반등이 나왔다고 평가했다. T-코모디티의 지안클라디오 토리지 전략가는 "그 동안 과매도에 따른 숏커버링으로 안도 랠리가 나오고 있다"면서 "미 달러 역시 미 경제와 마찬가지로 정점에 가까워지고 있어 금 바닥이 매우 가까웠다고 본다"고 평가했다. 다만 고용지표가 우수하게 나오면 금값에는 악재가 될 것이라고 전문가들은 분석했다.

■ Agriculture / Softs – 밀, 흑해 지역 강우 소식에 하락

러시아가 밀 수출에 대해서 제한을 두지 않기로 했다는 뉴스에 급락했던 밀 선물은 이달 말 흑해지역에 비가 예보되면서 다시 추가하락했다. 밀 선물은 지난 2영업일 동안 러시아가 수출물량에 대해 과세하지 않기로 하면서 4.4% 하락했었다. 건조했던 러시아, 우크라이나 지역 강우 소식은 추가 하락세를 이끌었다.

III. FX Strategy / FX 투자전략

전일 통화쌍 가격

구분	전일종가	전일비(%)	시가	고가	저가
Dollar Index	95.021	-0.17	95.10	95.21	94.93
EUR/USD	1.1623	-0.06	1.1630	1.1659	1.1606
GBP/USD	1.2930	0.19	1.2905	1.2962	1.2897
USD/JPY	110.75	-0.70	111.53	111.53	110.52

Market Review

■ FX - 달러화, 고용지표에 혼조 · 러시아 루블화 흔들

달러화 가치는 팽팽한 무역긴장 속에서 강한 미국 고용시장에 대한 확신이 줄어들며 혼조세를 보였다. 경제 활동에 중요한 지표인 8월 미국 고용보고서 발표를 하루 앞두고 이날 고용시장과 관련된 두 가지 지표가 엇갈리면서 강한 고용시장에 대한 기대치가 낮아졌다. 고용지표가 강해지면 연방준비제도(Fed연준)의 현재 속도로 금리 인상을 지속하게 되고, 이는 달러 상승 요인이 된다. 수익률을 추구하는 투자자들에게 차입 비용증가가 예상되면 달러는 더 매력적이 되기 때문이다. 이날 ADP전미고용보고서에 따르면 8월 민간부문 고용 증가는 16만3천 명으로, 시장 전망치 19만 명을 하회했다. 민간 신규 고용은 시장 예상치를 밑돈 반면 실업보험청구자수는 49년래 최저치로 떨어졌다. 2분기 생산성 증가율은 최근 3년 이상 동안 가장 높았다. 실리콘밸리 은행의 민 트랑 선임 외환 트레이더는 "내일 고용보고서가 더 시장에 영향을 미치겠지만, ADP 수치는 확실히 실망스러웠다"고 말했다.

Daily Chart



IV. Market Bulletin Board / 시장 도표

US/EU Index (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
미국 DOW	25995.87	0.08	-0.49	5.16
미국 NASDAQ	7922.73	-0.91	-2.31	14.77
미국 S&P500	2878.05	-0.37	-1.24	7.65
미국 Russell 2000	1714.47	-0.76	-1.17	11.65
영국 FTSE	7318.96	-0.87	-2.62	-4.80
프랑스 CAC40	5243.84	-0.31	-4.28	-1.29
독일 DAX	11955.25	-0.71	-4.31	-7.45
유럽 DJ Euro STOXX 50	3295.95	-0.59	-3.94	-5.94

ASIA Index (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
한국 KOSPI	2287.61	-0.18	-0.86	-7.29
한국 KOSDAQ	815.18	-0.59	1.33	2.10
일본 NIKKEI	22487.94	-0.41	-1.67	-1.22
홍콩 HangSeng	26974.82	-0.99	-4.22	-9.84
홍콩 H-Share	10578.58	-0.63	-3.55	-9.66
싱가폴 MSCI Singapore	1664.83	-0.26	-2.67	-8.09
대만 MSCI Taiwan	410.36	-0.74	-1.54	4.30
인도 CNX Nifty	11536.90	0.52	-1.20	9.55

Currency (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Dollar Index	95.02	-0.17	0.31	3.14
EUR/USD	1.1623	-0.06	-0.41	-3.18
GBP/USD	1.2930	0.19	-0.61	-4.31
AUD/USD	0.7200	0.10	-0.87	-7.80
NZD/USD	0.6589	-0.08	-1.02	-7.17
USD/CHF	0.9652	-0.67	-0.40	-0.93
USD/JPY	110.75	-0.70	-0.21	-1.72
USD/CAD	1.3142	-0.27	1.22	4.54

Interest Rate (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Eurodollar	97.045	0.02	0.06	-0.83
2 yr U.S. T-Notes	105.67	0.03	0.09	-1.29
5 yr U.S. T-Notes	113.35	0.10	0.15	-2.42
10 yr U.S. T-Notes	120.17	0.18	0.17	-3.12
30 yr U.S. T-Bonds	143.63	0.35	-0.15	-6.13
Euro Schatz (2yr)	111.89	0.03	-0.05	-0.08
Euro Bobl (5yr)	131.42	0.14	-0.11	-0.14
Euro Bond (10yr)	160.43	0.32	-0.02	-0.77

Energy (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Crude Oil (CME)	67.77	-1.38	-2.50	12.16
Natural Gas (CME)	2.772	-0.82	-3.18	-6.13
Heating Oil (CME)	220.91	-1.14	-1.77	6.82
Gasoline (CME)	195.1	-0.70	-2.44	8.64
Brent Crude (ICE)	76.5	-1.00	-1.95	14.40
Gas Oil (ICE)	680	-1.31	-1.41	13.00
ECX EUA (ICE)	21.47	5.40	1.47	162.47
ECX CER (ICE)	0.29	3.57	0.00	70.59

Agriculture (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Corn (CME)	366.25	0.27	2.73	4.42
Wheat (CME)	513.75	-1.53	-5.17	20.32
Soybean (CME)	839.25	0.15	0.39	-12.74
Soybean Oil (CME)	28.53	-0.11	0.39	-14.22
Soybean Meal (CME)	314	1.39	2.88	-0.88
Oats (CME)	247	0.20	-2.47	2.49
Rough Rice (CME)	10.88	0.65	0.14	-8.61
Live Cattle (CME)	108.9	-0.14	0.18	-10.41
Feeder Cattle (CME)	151.525	0.03	1.42	6.20
Lean Hogs (CME)	54.975	5.77	6.64	-23.41
Cocoa (ICE)	2281	-1.30	-2.89	20.56
Cotton No2 (ICE)	81.3	-0.50	-1.76	3.40
Coffee C (ICE)	102.2	-1.54	-0.68	-19.02
Sugar No11 (ICE)	10.8	-0.83	4.15	-28.76
FCOJ-A (ICE)	152.7	-0.13	-0.23	11.58

Metal (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
GOLD (CME)	1204.3	0.25	-0.59	-8.02
Silver (CME)	14.181	-0.27	-4.25	-17.29
Platinum (CME)	790.9	0.84	-0.72	-15.71
H-G Copper	263.65	1.02	-3.65	-20.12

Commodity Index (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
RJ-CRB	189.78	-0.64	-1.64	-2.11
RICI 종합	2435.27	-0.57	-1.82	0.80
RICI 에너지	406.39	-1.07	-2.04	14.64
RICI 금속	1923.99	0.02	-3.00	-13.83
RICI 농산물	775.41	-0.40	-0.74	-3.78

Bloomberg / 한국투자증권

V. Economic Indicator / 경제지표 및 이벤트 일정

일시	시간	국가	지표/이벤트	기간	예상	발표	이전
09월 06일	20:30	US	Challenger Job Cuts YoY	Aug	--	13.70%	-4.20%
09월 06일	21:15	US	ADP취업자 변동	Aug	200k	163k	219k
09월 06일	21:30	US	비농업부문 노동생산성	2Q F	3.00%	2.90%	2.90%
09월 06일	21:30	US	단위노동비용지수	2Q F	-0.90%	-1.00%	-0.90%
09월 06일	21:30	US	신규 실업수당 청구건수	01-Sep	213k	203k	213k
09월 06일	21:30	US	실업보험연속수급신청자수	25-Aug	1720k	1707k	1708k
09월 06일	22:45	US	마켓 미국 서비스 PMI	Aug F	55.2	54.8	55.2
09월 06일	22:45	US	마켓 미국 종합 PMI	Aug F	--	54.7	55
09월 06일	23:00	US	ISM Non-Manufacturing Index	Aug	56.8	58.5	55.7
09월 06일	23:00	US	제조업수주	Jul	-0.60%	-0.80%	0.70%
09월 06일	23:00	US	내구재 주문	Jul F	-1.70%	-1.70%	-1.70%
09월 06일	23:30	US	EIA 가동 천연가스 내재 흐름	31-Aug	61	63	70
09월 06일	23:30	US	EIA 천연가스 비축량 변동	31-Aug	61	63	70
09월 07일	0:00	US	DOE 총 연료 에탄올 재고	31-Aug	--	22703k	23061k
09월 07일	0:00	US	DOE 연료 에탄올 총 생산	31-Aug	--	1087k	1070k
09월 07일	0:00	US	DOE 미국 원유 재고	31-Aug	-2900k	-4302k	-2566k
09월 07일	0:00	US	DOE 쿠싱 OK 원유 재고	31-Aug	--	549k	58k
09월 07일	0:00	US	DOE 미국 휘발유 재고	31-Aug	-1500k	1845k	-1554k
09월 07일	0:00	US	DOE U.S. Distillate Inventory	31-Aug	700k	3119k	-837k
09월 07일	0:00	US	DOE U.S. Refinery Utilization	31-Aug	-0.30%	0.30%	-1.80%
09월 07일	0:00	US	DOE 원유 내재 수요	31-Aug	--	19329	18852
09월 07일	0:00	US	DOE 휘발유 내재 수요	31-Aug	--	10210.6	10484.1
09월 07일	0:00	US	DOE 증류유 내재 수요	31-Aug	--	5279.4	5572.6
09월 07일	15:00	GE	무역수지	Jul	19.5b	--	21.8b
09월 07일	15:00	GE	경상수지	Jul	20.0b	--	26.2b
09월 07일	15:00	GE	수출 SA MoM	Jul	0.30%	--	0.00%
09월 07일	15:00	GE	수입 SA MoM	Jul	0.10%	--	1.20%
09월 07일	15:00	GE	산업생산 SA MoM	Jul	0.20%	--	-0.90%
09월 07일	15:00	GE	노동 비용 SA QoQ	2Q	--	--	1.00%
09월 07일	15:45	FR	무역수지	Jul	-5739m	--	-6248m
09월 07일	15:45	FR	경상수지	Jul	--	--	-2.3b
09월 07일	15:45	FR	광공업생산 MoM	Jul	0.20%	--	0.60%
09월 07일	15:45	FR	제조업 생산 전월비	Jul	0.20%	--	0.60%
09월 07일	21:30	US	비농업부문고용자수 변동	Aug	191k	--	157k
09월 07일	21:30	US	2개월 급여 순 수정	Aug	--	--	--
09월 07일	21:30	US	민간부문 고용자수 변동	Aug	194k	--	170k
09월 07일	21:30	US	제조업임금변동	Aug	23k	--	37k
09월 07일	21:30	US	실업률	Aug	3.80%	--	3.90%
09월 07일	21:30	US	시간당 평균 임금(전월대비)	Aug	0.20%	--	0.30%
09월 08일	2:00	US	베이커휴즈 미국 로터리 가스 시추공	07-Sep	--	--	184

●본 자료는 고객의 증권투자를 돕기 위하여 작성된 당사의 저작물로서 모든 저작권은 당사에게 있으며, 당사의 동의 없이 어떤 형태로든 복제, 배포, 전송, 변형할 수 없습니다.
 ●본 자료는 당사 해외투자영업부에서 수집한 자료 및 정보를 기초로 작성된 것이나 당사가 그 자료 및 정보의 정확성이나 완전성을 보장할 수는 없으므로 당사는 본 자료로서 고객의 투자 결과에 대한 어떠한 보장도 행하는 것이 아닙니다. 최종적 투자 결정은 고객의 판단에 기초한 것이며 본 자료는 투자 결과와 관련한 법적 분쟁에서 증거로 사용될 수 없습니다.