

Futures/FX Daily

해외투자영업부
2020.02.24 (월)

[24hr DESK: 1577-1282]

I. Global Market / 글로벌 마켓

주요국 주가지수

구분	전일종가	전일비(%)	1wk(%)	YTD(%)
미국 DOW	28,992.41	-0.78	-1.46	1.59
미국 NASDAQ	9,576.59	-1.79	-1.39	6.73
미국 S&P500	3,337.75	-1.05	-1.07	3.31
영국 FTSE	7,403.92	-0.44	-0.07	-1.84
DJ Euro STOXX 50	3,800.38	-0.59	-1.06	1.47
일본 NIKKEI	23,386.74	-0.39	-1.27	-1.14
홍콩 Hang Seng	27,308.81	-1.09	-1.82	-3.13
KOSPI	2,162.84	-1.49	-3.60	-1.58

Market Review

■ 글로벌 증시 - 뉴욕증시, 코로나19 경제 악영향 공포에 하락

뉴욕 증시에서 주요 지수가 21일(현지시간) 하락 마감했다. 주말을 앞둔 투자자들은 코로나19(COVID-19)가 확산하며 경제가 더 위축될 것을 우려했다. 다우존스산업평균지수는 이날 227.57포인트(0.78%) 하락한 2만8992.41에 마감했고 나스닥 종합지수는 174.37포인트(1.79%) 내린 9576.59로 집계됐다. 스탠더드앤드푸어스(S&P)500지수는 35.48포인트(1.05%) 하락한 3337.75를 기록했다. 주간 기준으로 다우지수는 1.4%, 나스닥지수는 1.6%, S&P500지수는 1.3% 각각 하락했다.

이날 월가 투자자들은 주말을 앞두고 다시 코로나19이 경제에 미칠 악영향을 우려했다. 밤사이 중국에서 800명 이상의 확진자가 추가로 발표되면서 증시 투자자들은 코로나19 사태가 결국 수요 감소와 공급망 왜곡으로 이어질 것으로 내다봤다. BCA리서치의 피터 비르진 수석 글로벌 전략가는 보고서에서 "바이러스가 후퇴하더라도 세계 성장률은 올해 남은 기간 반등하기 전 1분기 제로(0)%로 떨어질 것"이라면서 "따라서 기업 이익에 대한 단기 타격은 피할 수 없어 보인다"고 말했다.

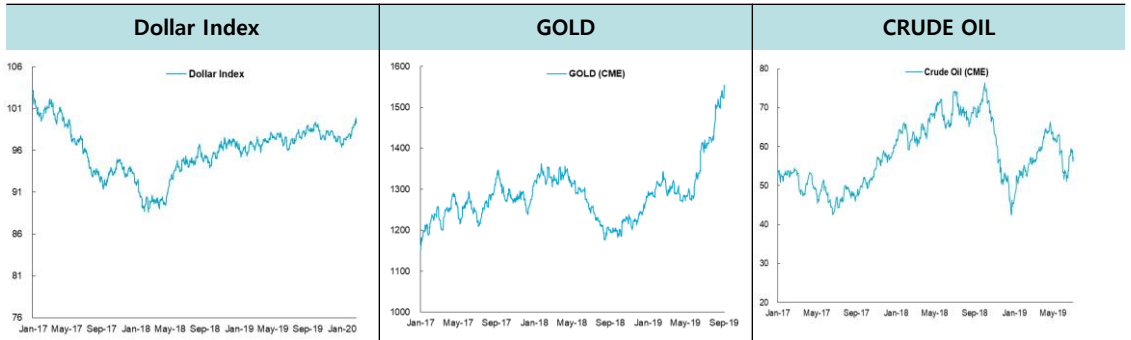
중국에서 수요 둔화는 점차 가시화하고 있다. 이번 달 2주 동안 중국의 자동차 판매는 92%나 급감했다. 애플과 같은 일부 미국 기업들 역시 코로나19의 역풍으로 이번 분기 매출 목표를 달성하지 못할 가능성을 경고하고 있다. 단스케뱅크의 미카엘 올라이 밀호즈 선임 애널리스트는 보고서에서 "중국의 경제적 폐쇄는 세계 경제에 부정적인 영향을 줬다고 본다"면서 "상당수의 선박 운항이 12월 이후 5% 이상 감소했고 인민은행의 완화 정책에도 불구하고 어떤 통화정책이 이것에 영향을 미칠 수 있는지 불확실하다"고 지적했다.

경제 지표도 부진했다. IHS마킷은 미국의 서비스업 경기가 6년간 가장 침체했다고 밝혔다. 이날 발표된 마킷 서비스업 구매관리자지수(PMI)는 2월 49.4로 잠정 집계돼 1월 53.4보다 하락했다. PMI는 50을 밑돌면 경기 위축을 나타낸다. 투자 수요는 안전자산인 국채와 금으로 몰렸다. 30년 만기 미국 채금리는 1.9% 밑으로 떨어져 사상 최저치를 기록했다. 금 선물 가격은 온스당 1647.40달러까지 오르며 7년간 최고치를 다시 썼다.

II. Futures / 해외선물

전일 상품가격

구분	전일증가	전일비(%)	시가	고가	저가
Crude Oil	53.38	-0.93	53.74	53.86	52.55
N.Gas	1.905	-0.78	1.915	1.925	1.861
Gold	1,648.8	1.75	1,623.6	1,652.1	1,621.6
H-G Bopper	261.6	0.77	259.9	262.4	257.0
Corn	380.75	-0.52	382.25	384.25	380.00
Wheat	552.00	-1.30	559.25	568.25	551.00
Soybean	899.00	-0.22	900.25	910.25	896.25



(자료: Bloomberg, 한국투자증권)

■ Energy – 국제유가, 경기 부진 및 코로나 공포로 하락세 전환

21일(현지시각) 국제 유가가 급락했다. 경제부진 및 신종 코로나바이러스 공포 속에 유가가 급락세로 전환됐다. 이날 뉴욕상업거래소에서 미국 동부시각 오후 2시21분 기준 미국서부텍사스산원유 4월물 가격은 배럴당 53.41 달러로 1.10% 하락했다. 같은 시각 런던ICE 선물거래소에서 사고팔린 북해산 브렌트유 4월물 가격은 배럴당 58.42 달러로 1.50%나 떨어졌다. 최근 유가는 급등세를 보이다가 이날 하락전환했다. 미국 경제방송 CNBC는 "이날 유가가 급락세로 전환됐으나 주간 기준으로는 2주 연속 상승했다"고 전했다. 이 방송은 "이날 유가 급락 속에 장중 미국증시 에너지 섹터의 주가도 급락했다"면서 "장중 엑손모빌(-0.97%) 마라톤오일(-0.88%) NOBLE ENERGY(-3.23%) DEVON ENERGY(-5.08%) 등의 주가가 하락세를 나타냈다"고 전했다.

■ Precious Metal – 금, 코로나19 감염자수 증가 1.8% 상승

뉴욕 금 가격은 코로나19 감염자 수가 증가했다는 소식이 전해지며 안전자산 수요가 늘어나 1.8% 상승했다. 21일 뉴욕상품거래소에서 4월물 금 가격은 전 거래일보다 28.30달러(1.8%) 상승한 1,648.80 달러에 마감했다. 이번 주 금값은 3.9% 상승했는데, 지난해 8월 이후 주간 수익률로는 가장 높다. 한국에서 코로나19 확진자가 200명을 넘었고, 일본과 한국 등에서 사망자도 발생했다. 중국에서도 후베이 성 바깥에 위치한 두 개의 교도소에서 200명이 넘는 새로운 확진자가 발생했다. 이로 인해 뉴욕 증시는 하락 중이고 세계 증시 역시 전반적으로 하락했다. 퀀티테이티브 코모디티 리서치의 피터 페티그 전략가는 "안전자산으로 움직임이 금을 지지하고 있다"면서 "증시는 하락하고 있고 국채는 상승하고 있다"고 말했다. 이에 골드만삭스는 "2분기까지 바이러스가 잡히지 않는다면 금값은 단기적으로 1,850 달러까지 오를 수 있다"고 말했다.

■ Agriculture / Softs – 수요 감소 우려로 농산물 전 종목 약세

글로벌 수요 감소에 대한 우려로 대두, 옥수수, 소맥은 전 종목 하락 마감하였다. 한편 금일 미국 농무부는 주요 곡물의 2020/21년도 기말 재고 예상치를 발표하였다. 대두는 3.2억 부셸로 전년대비 소폭 감소할 것으로 나타났고, 옥수수는 26.37억 부셸로 사상 최대 수준의 재고 수준을 기록할 것으로 전하여 졌다.

III. FX Strategy / FX 투자전략

전일 통화쌍 가격

구분	전일종가	전일비(%)	시가	고가	저가
Dollar Index	99.262	-0.60	99.86	99.87	99.23
EUR/USD	1.0847	0.57	1.0785	1.0864	1.0785
GBP/USD	1.2964	0.64	1.2881	1.2981	1.2878
USD/JPY	111.61	-0.44	112.10	112.19	111.47

Market Review

■ FX - 달러화, 레벨 부담 숨 고르기, 엔 상승 전환

달러화 가치는 연속 상승 부담에 숨 고르기를 나타냈다. 21일 오전 9시(이하 미국 동부 시각) 뉴욕 외환시장에서 달러화는 주요 6개 통화에 대한 달러 가치를 반영한 달러 인덱스는 전장보다 0.21% 하락한 99.655를 기록했다. 신종 코로나바이러스 감염증(코로나19) 우려는 지속하지만, 주요 통화는 되돌림 장세를 나타내고 있다. 코로나19가 글로벌 경제에 악영향을 미칠 것이라는 우려 속에서 달리는 탄탄한 미국 경제지표, 상대적으로 높은 금리 등에 연속 상승했다. 달러 인덱스는 전일까지 2017년 5월 이후 가장 높은 수준을 유지했으며 거의 3년 동안 한 번도 터치하지 못했던 100선에 가까워졌다. 달러 강세 동안 일본 경제에 대한 우려, 코로나19 여파 등에 엔 약세가 특히 두드러졌다. 이날 엔은 저가 매수에 상승 반전했다. 엔은 이틀 동안 달러에 2% 정도 내렸고, 이를 포함해 지난 4거래일 동안 엔의 움직임은 최근 2년 이내 가장 나빴다. 최근 유로도 부진한 독일 경제 지표 등에 2014년 4월 이후 처음으로 달러에 심리적 지지선인 1.08달러대를 내주기도 했다.

Daily Chart

EUR/USD (30 min Chart)



USD/JPY (30 min Chart)



IV. Market Bulletin Board / 시장 도표

US/EU Index (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
미국 DOW	28992.41	-0.78	-1.46	1.59
미국 NASDAQ	9576.59	-1.79	-1.39	6.73
미국 S&P500	3337.75	-1.05	-1.07	3.31
미국 Russell 2000	1678.61	-1.03	-0.89	0.61
영국 FTSE	7403.92	-0.44	-0.07	-1.84
프랑스 CAC40	6029.72	-0.54	-0.65	0.86
독일 DAX	13579.33	-0.62	-1.20	2.49
유럽 DJ Euro STOXX 50	3800.38	-0.59	-1.06	1.47

ASIA Index (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
한국 KOSPI	2162.84	-1.49	-3.60	-1.58
한국 KOSDAQ	667.99	-2.01	-3.04	-0.27
일본 NIKKEI	23386.74	-0.39	-1.27	-1.14
홍콩 HangSeng	27308.81	-1.09	-1.82	-3.13
홍콩 H-Share	10790.84	-1.13	-0.67	-3.38
싱가폴 MSCI Singapore	1700.57	-0.49	-1.53	-2.21
대만 MSCI Taiwan	449.30	-0.35	-1.71	-2.95
인도 CNX Nifty	12080.85	-0.37	-0.77	-0.72

Currency (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Dollar Index	99.26	-0.60	0.14	2.98
EUR/USD	1.0847	0.57	0.15	-3.26
GBP/USD	1.2964	0.64	-0.64	-2.21
AUD/USD	0.6627	0.18	-1.30	-5.61
NZD/USD	0.6349	0.25	-1.38	-5.80
USD/CHF	0.9782	-0.60	-0.42	1.20
USD/JPY	111.61	-0.44	1.67	2.76
USD/CAD	1.3225	-0.26	-0.20	1.81

Interest Rate (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Eurodollar	98.535	0.05	0.10	0.27
2 yr U.S. T-Notes	108.11	0.08	0.16	0.34
5 yr U.S. T-Notes	120.30	0.21	0.48	1.42
10 yr U.S. T-Notes	131.86	0.32	0.84	2.68
30 yr U.S. T-Bonds	164.97	0.63	1.91	5.81
Euro Schatz (2yr)	112.03	0.00	-0.01	0.11
Euro Bobl (5yr)	134.73	-0.04	0.00	0.82
Euro Bond (10yr)	174.93	-0.02	0.26	2.60

Energy (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Crude Oil (CME)	53.38	-0.93	3.33	-12.58
Natural Gas (CME)	1.905	-0.78	4.33	-12.97
Heating Oil (CME)	168.66	-0.65	0.36	-16.62
Gasoline (CME)	165.06	-1.14	4.46	-2.36
Brent Crude (ICE)	58.5	-1.37	2.06	-11.36
Gas Oil (ICE)	508.5	-2.02	-1.17	-17.18
ECX EUA (ICE)	25.61	-0.12	5.43	3.94
ECX CER (ICE)	0.24	0.00	14.29	9.09

Agriculture (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Corn (CME)	380.75	-0.52	-1.04	-1.81
Wheat (CME)	552	-1.3	1.33	-1.21
Soybean (CME)	899	-0.22	-0.77	-5.91
Soybean Oil (CME)	31.01	1.77	-0.26	-10.81
Soybean Meal (CME)	294.8	-1.17	-0.94	-3.25
Oats (CME)	298	-0.5	1.02	2.05
Rough Rice (CME)	13.59	-0.48	0.37	2.30
Live Cattle (CME)	118.25	-0.76	-0.23	-6.09
Feeder Cattle (CME)	140.2	-0.43	2.84	-2.79
Lean Hogs (CME)	67.025	0.22	4.6	-6.16
Cocoa (ICE)	2843	-0.59	-1.8	11.93
Cotton No2 (ICE)	69	-0.53	0.54	-0.07
Coffee C (ICE)	110.25	5.05	3.33	-15.00
Sugar No11 (ICE)	15.12	1.2	2.3	12.67
FCOJ-A (ICE)	100.85	0.55	-0.84	1.10

Metal (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
GOLD (CME)	1648.8	1.75	4.43	8.25
Silver (CME)	18.613	1.14	5.15	3.86
Platinum (CME)	976.1	-0.30	0.14	-0.17
H-G Copper	261.6	0.77	-0.15	-6.47

Commodity Index (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
RJ-CRB	174.65	-0.05	1.38	-6.00
RICI 종합	2315.07	-0.34	1.45	-5.68
RICI 에너지	338.93	-1.12	2.82	-11.83
RICI 금속	2123.53	0.49	0.82	-0.88
RICI 농산물	740.88	-0.04	0.38	-2.35

Bloomberg / 한국투자증권

V. Economic Indicator / 경제지표 및 이벤트 일정

일시	시간	국가	지표/이벤트	기간	예상	발표	이전
02월 21일	0:00	US	선행지수	Jan	0.40%	0.80%	-0.30%
02월 21일	0:00	EC	소비자기대지수	Feb A	-8.2	-6.6	-8.1
02월 21일	0:30	US	EIA 가동 천연가스 내재 흐름	14-Feb	-145	-151	-115
02월 21일	0:30	US	EIA 천연가스 비축량 변동	14-Feb	-145	-151	-115
02월 21일	1:00	US	DOE 미국 원유 재고	14-Feb	3200k	415k	7459k
02월 21일	1:00	US	DOE 쿠싱 OK 원유 재고	14-Feb	--	-133k	1668k
02월 21일	1:00	US	DOE 미국 휘발유 재고	14-Feb	200k	-1971k	-95k
02월 21일	18:00	EC	마켓 유로존 제조업 PMI	Feb P	47.4	49.1	47.9
02월 21일	18:00	EC	마켓 유로존 서비스 PMI	Feb P	52.3	52.8	52.5
02월 21일	18:00	EC	마켓 유로존 종합 PMI	Feb P	51	51.6	51.3
02월 21일	19:00	EC	CPI (전년대비)	Jan	1.40%	1.40%	1.40%
02월 21일	19:00	EC	CPI (전월대비)	Jan F	-1.00%	-1.00%	-1.00%
02월 21일	19:00	EC	CPI 근원 전년대비	Jan F	1.10%	1.10%	1.10%
02월 21일	21:00	US	USDA Outlook Corn End Stocks	2020	--	2637m	1650m
02월 21일	21:00	US	USDA Outlook Soybean End Stock	2020	--	320m	845m
02월 21일	21:00	US	USDA Outlook Wheat End Stocks	2020	--	777m	944m
02월 21일	21:00	US	USDA Outlook Cotton End Stocks	2020	--	5.3m	6.3m
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 옥수수-총	13-Feb	--	1250.2	968.8
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 옥수수-기존 작물	13-Feb	--	1249.2	968.8
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 대두-총	13-Feb	--	497.6	651.1
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 대두-기존	13-Feb	--	494.3	644.8
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 소맥-총	13-Feb	--	406.4	687.1
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 소맥-기존	13-Feb	--	346.3	643.1
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 원면-총	13-Feb	--	376.5	408.1
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 원면-기존	13-Feb	--	235.3	350.9
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 대두박-총	13-Feb	--	169.4	234.2
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 대두유-총	13-Feb	--	42	39.1
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 돈육-총	13-Feb	--	23.8	28.6
02월 21일	22:30	US	순 수출 매출 쇠고기-총	13-Feb	--	19.4	17.4
02월 21일	23:45	US	마켓 미국 제조업 PMI	Feb P	51.5	50.8	51.9
02월 21일	23:45	US	마켓 미국 서비스 PMI	Feb P	53.4	49.4	53.4
02월 21일	23:45	US	마켓 미국 종합 PMI	Feb P	--	49.6	53.3
02월 22일	0:00	US	Revisions: Existing Home Sales				
02월 22일	0:00	US	기존주택매매	Jan	5.44m	5.46m	5.54m
02월 22일	0:00	US	기존주택매매 (전월대비)	Jan	-1.80%	-1.30%	3.60%
02월 22일	3:00	US	베이커휴즈 미국 로터리 석유 시추공	21-Feb	677	679	678
02월 22일	3:00	US	베이커휴즈 미국 로터리 가스 시추공	21-Feb	110	110	110
02월 25일	23:00	US	주택 가격 구매지수 QoQ	4Q	--	--	1.10%
02월 25일	23:00	US	FHFA 주택가격지수 MoM	Dec	0.40%	--	0.20%

- 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 자료로써 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.