

Futures / FX Daily

해외투자영업부
2018.12.28 (금)

[24hr DESK: 1577-1282]

I . Global Market / 글로벌 마켓

주요국 주가지수

| 구분 | 전일종가 | 전일비(%) | 1wk(%) | YTD(%) |
|------------------|-----------|--------|--------|--------|
| 미국 DOW | 23,138.82 | 1.14 | -0.79 | -6.39 |
| 미국 NASDAQ | 6,579.49 | 0.38 | -0.86 | -4.69 |
| 미국 S&P500 | 2,488.83 | 0.86 | -0.72 | -6.91 |
| 영국 FTSE | 6,584.68 | -1.52 | -1.74 | -14.35 |
| DJ Euro STOXX 50 | 2,937.36 | -1.22 | -3.38 | -16.17 |
| 일본 NIKKEI | 20,077.62 | 3.88 | -4.34 | -11.88 |
| 홍콩 Hang Seng | 25,478.88 | -0.67 | -1.30 | -14.84 |
| KOSPI | 2,028.44 | 0.02 | -2.42 | -17.79 |

Market Review

■ 글로벌 증시 - 뉴욕증시, 급락 출발 뒤 막판 상승반전

뉴욕증시가 미·중 간 무역 긴장에도 장 후반 저점 매수세가 유입되면서 반등에 성공했다. 27일(미국 시간) 뉴욕증권거래소(NYSE)에서 다우존스 30 산업평균지수는 전일 대비 260.37포인트(1.14%) 오른 2만3138.82에 거래를 마쳤다. 스탠더드앤드푸어스(S&P) 500 지수는 21.13포인트(0.86%) 상승한 2488.83에, 기술주 중심의 나스닥 지수는 25.14포인트(0.38%) 오른 6579.49에 장을 마감했다.

시장은 미 정부의 부분 폐쇄(셋다운) 등 정국 상황과 미·중 간 무역협상 이슈, 주요 경제지표 등을 주시했다. 전일 증시에서는 다우 지수가 사상 처음으로 하루 만에 1000포인트 이상 오르는 등 기록적인 상승세가 나타났다. 성탄 전야 급락에 대한 반발 성격도 강했다.

이날은 주가지수가 큰 폭 하락했다가 급격히 반등하는 등 극심한 변동성을 보였다. 미국과 중국의 무역 긴장이 재차 커지면서 장 후반까지 시장이 불안했다.

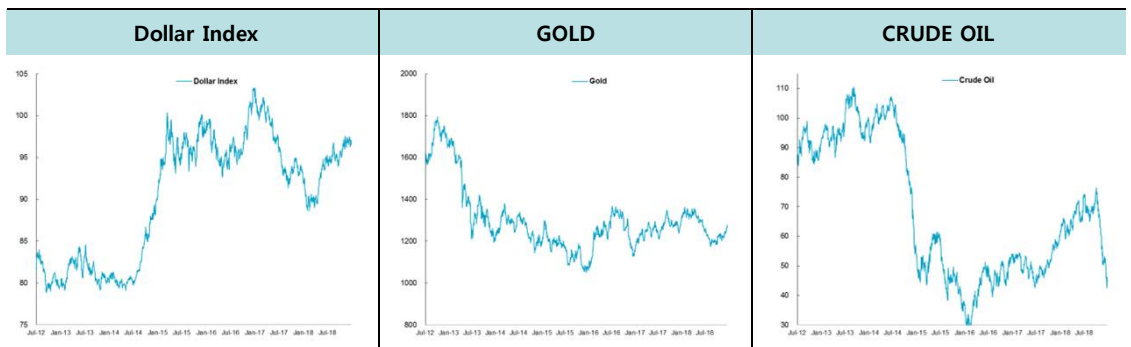
백악관이 중국 화웨이와 ZTE(중신통신)의 장비와 부품 구매를 금지하는 행정명령을 검토 중이라는 소식이 나왔다. 미국 기업들이 국가안보 위협 의혹이 제기된 이들 업체 장비 사용을 금지하는 국가 비상사태를 선포하는 방안을 검토 중이라는 것이다. 이는 8개월 넘게 검토됐으며 이르면 내년 1월 발동될 수 있다고 소식통들은 전했다.

미국 정부 셋다운 불확실성도 지속했다. 도널드 트럼프 대통령은 전일 얼마나 오래 걸리든지 간에 국경장벽건설 예산이 반영될 때까지 기다릴 것이라고 말했다. 이날도 트위터를 통해 국경장벽 필요성을 역설하면서 이에 반대하는 민주당을 비판했다.

II. Futures / 해외선물

전일 상품가격

| 구분 | 전일증가 | 전일비(%) | 시가 | 고가 | 저가 |
|------------|---------|--------|---------|---------|---------|
| Crude Oil | 44.61 | -3.48 | 46.58 | 46.70 | 44.37 |
| N.Gas | 3.546 | 2.54 | 3.424 | 3.554 | 3.359 |
| Gold | 1,281.1 | 0.64 | 1,270.1 | 1,281.6 | 1,269.1 |
| H-G Bopper | 266.8 | -1.19 | 270.2 | 270.7 | 265.8 |
| Corn | 374.50 | 0.33 | 373.25 | 376.50 | 373.25 |
| Wheat | 510.50 | 0.10 | 511.50 | 513.00 | 507.25 |
| Soybean | 882.50 | -0.06 | 883.75 | 889.00 | 880.50 |



(자료: Bloomberg, 한국투자증권)

Market Review

■ Energy – 국제유가, 증시 반락에 연동하여 하락

뉴욕 유가는 전일 9% 가까운 폭등 반작용과 주가지수 하락 영향으로 내렸다. 원유시장 참가자들은 뉴욕 증시 주가 지수 움직임을 주시했다. 전일 다우존스 30 산업평균지수가 사상 처음으로 1,000포인트 이상 오르는 등 기록적인 상승세를 보였던 증시가 이날은 재차 불안하다. 미 행정부가 중국 화웨이와 ZTE(중신통신)의 장비와 부품 구매를 금지하는 행정명령을 검토 중이라는 소식 등으로 미중 간 무역협상에 대한 긴장이 재차 커졌다. 중국과 미국의 협상단이 다음 달 중국에서 협상할 것이라는 긍정적인 소식도 있었지만, 시장은 양국 긴장이 고조될 가능성을 더 우려했다. 도널드 트럼프 대통령은 이날도 자신의 트위터를 통해 국경장벽 건설 예산에 반대하고 있는 민주당에 대한 비난을 내놨다. 리터부시 앤드 어소시에이츠의 짐 리터부시 대표는 "중요 원유 관련 소식이 부재한 가운데 유가는 이번 주 극단적인 변동성을 보이는 증시의 공무니를 따라다니고 있다"고 평가했다.

■ Precious Metal – 금, 증시 다시 불안에 상승

뉴욕 금 가격은 뉴욕 증시 주요 주가지수가 재차 가파르게 하락하면서 안전자산 수요가 높아져 0.6% 상승했다. 싱크마켓의 나임 아슬람 수석 시장 전략가는 "이날 금값은 6개월만의 최고치 수준에서 움직이고 있다"면서 "전날 증시 급락에도 불구하고 투자자들은 증시 관련 위험 등을 고려하고 있다"고 전했다. 달러 역시 하락하며 금값 상승을 도왔다. 킷코메탈스의 짐 와이코프 선임 전략가는 "달러 약세는 금 매수를 지지하고 있고 미 증시가 급격하게 하락하는 것 역시 금 상승 압력으로 작용했다"면서 "단기적으로 기술적 측면으로도 금 시장은 강세장을 가리키고 있다"고 분석했다. 이번 아 나라 내년 경제 성장 우려, 금리 인상, 미 정부 부분폐쇄(셧다운) 등 다양한 요인들이 안전자산 수요를 높이고 있다고 전문가들은 전했다.

■ Agriculture / Softs – 대두, 저가 매수세에 반등

한달래 저점을 기록한 옥수수, 대두 선물은 저가 매수세 유입에 반등에 성공했다. 대두 선물 가격은 중국과의 분쟁으로 수출량이 제한되면서 5거래일 연속 하락했었다. 대두 선물 미결제 잔고는 2017년 말 이후 가장 적었다.

III. FX Strategy / FX 투자전략

전일 통화쌍 가격

| 구분 | 전일종가 | 전일비(%) | 시가 | 고가 | 저가 |
|--------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Dollar Index | 96.481 | -0.59 | 0.21 | 77.00 | 76.43 |
| EUR/USD | 1.1430 | 0.68 | 1.1353 | 1.1454 | 1.1352 |
| GBP/USD | 1.2644 | 0.09 | 1.2633 | 1.2675 | 1.2616 |
| USD/JPY | 111.01 | -0.32 | 111.37 | 111.37 | 110.46 |

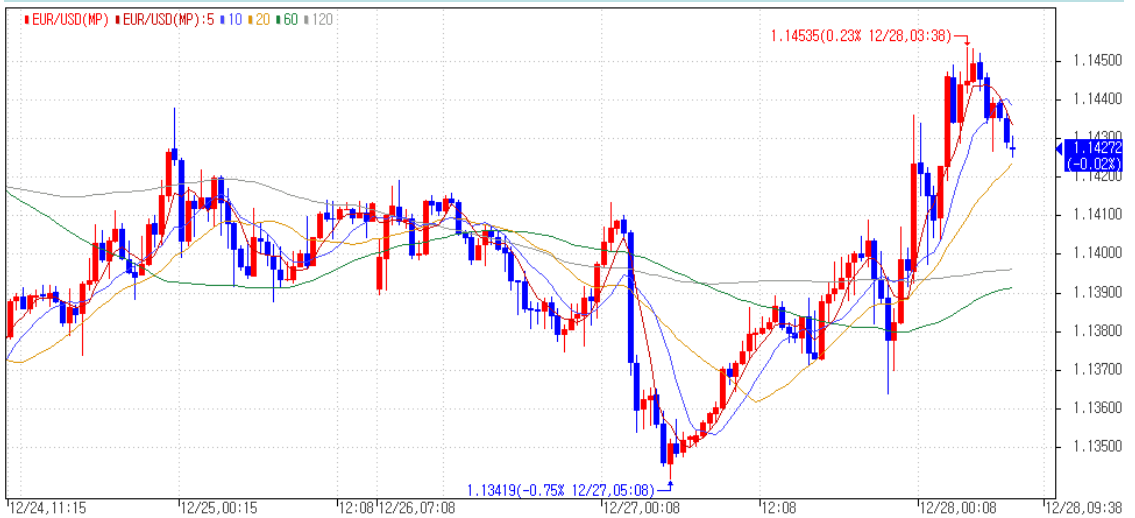
Market Review

■ FX - 달러화, 증시 변동성 속 약세

달러화 가치는 뉴욕증시가 극심한 변동성을 보이는 가운데, 위험회피 심리 강화 등으로 하락했다. 전일 뉴욕증시 주요 3개 지수가 일제히 4% 이상 기록적인 수준으로 급등했지만, 이날 다시 급격한 변동성을 보이면서 달러약세를 자극했다. 다우존스 30 산업평균지수는 이날 장중 한때 610포인트 이상 내리는 등 불안을 노출했다. 다우지수를 비롯한 주요지수는 다만 장 막판 급격히 반등해 상승세로 마감했다. 백악관이 중국 화웨이와 ZTE(중신통신)의 장비와 부품 구매를 금지하는 행정명령을 검토 중이라는 소식으로 양국 긴장이 고조된 점이 장초반 불안을 자극했다. 중국의 11월 공업이익이 전년동기 대비 1.8% 감소하는 등 경기 부진 우려도 지속했다. 중국 공업이익이 전년대비 감소한 것은 지난 2015년 12월 이후 약 3년 만에 처음이다. 미국 정부 부분 폐쇄(셧다운)에 대한 우려도 지속했다. 도널드 트럼프 대통령은 이날도 자신의 트위터를 통해 국경장벽의 필요성을 역설했으며, 이에 반대하는 민주당에 대한 비판을 이어갔다.

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 | 23138.82 | 1.14 | -0.79 | -6.39 |
| 미국 NASDAQ | 6579.49 | 0.38 | -0.86 | -4.69 |
| 미국 S&P500 | 2488.83 | 0.86 | -0.72 | -6.91 |
| 미국 Russell 2000 | 1331.82 | 0.15 | -1.29 | -13.27 |
| 영국 FTSE | 6584.68 | -1.52 | -1.74 | -14.35 |
| 프랑스 CAC40 | 4598.61 | -0.60 | -3.27 | -13.44 |
| 독일 DAX | 10381.51 | -2.37 | -3.63 | -19.63 |
| 유럽 DJ Euro STOXX 50 | 2937.36 | -1.22 | -3.38 | -16.17 |

| ASIA Index (%) | | | | |
|--------------------|----------|-------|-------|--------|
| 구분 | 전일종가 | 전일비 | 1wk | YTD |
| 한국 KOSPI | 2028.44 | 0.02 | -2.42 | -17.79 |
| 한국 KOSDAQ | 667.88 | 0.32 | -0.62 | -16.35 |
| 일본 NIKKEI | 20077.62 | 3.88 | -4.34 | -11.80 |
| 홍콩 HangSeng | 25478.88 | -0.67 | -1.30 | -14.84 |
| 홍콩 H-Share | 9991.06 | -0.71 | -2.34 | -14.67 |
| 싱가폴 MSCI Singapore | 1590.92 | 1.03 | -0.81 | -12.17 |
| 대만 MSCI Taiwan | 354.76 | 1.88 | -0.35 | -9.83 |
| 인도 CNX Nifty | 10779.80 | 0.47 | -1.71 | 3.30 |

| Currency (%) | | | | |
|--------------|--------|-------|-------|-------|
| 구분 | 전일종가 | 전일비 | 1wk | YTD |
| Dollar Index | 96.48 | -0.59 | 0.21 | 4.73 |
| EUR/USD | 1.1430 | 0.68 | -0.14 | -4.85 |
| GBP/USD | 1.2644 | 0.09 | -0.09 | -6.36 |
| AUD/USD | 0.7033 | -0.47 | -1.06 | -9.89 |
| NZD/USD | 0.6702 | -0.45 | -1.09 | -5.67 |
| USD/CHF | 0.9880 | -0.77 | 0.01 | 1.33 |
| USD/JPY | 111.01 | -0.32 | -0.24 | -1.44 |
| USD/CAD | 1.3619 | 0.33 | 0.81 | 8.56 |

| Interest Rate (%) | | | | |
|--------------------|--------|------|------|-------|
| 구분 | 전일종가 | 전일비 | 1wk | YTD |
| Eurodollar | 97.335 | 0.07 | 0.14 | -0.53 |
| 2 yr U.S. T-Notes | 106.07 | 0.10 | 0.20 | -0.92 |
| 5 yr U.S. T-Notes | 114.37 | 0.27 | 0.32 | -1.54 |
| 10 yr U.S. T-Notes | 121.53 | 0.41 | 0.30 | -2.03 |
| 30 yr U.S. T-Bonds | 145.53 | 0.54 | 0.34 | -4.88 |
| Euro Schatz (2yr) | 111.95 | 0.05 | 0.06 | -0.02 |
| Euro Bobl (5yr) | 132.55 | 0.14 | 0.19 | 0.71 |
| Euro Bond (10yr) | 163.73 | 0.23 | 0.24 | 1.27 |

| Energy (%) | | | | |
|-------------------|--------|-------|-------|--------|
| 구분 | 전일종가 | 전일비 | 1wk | YTD |
| Crude Oil (CME) | 44.61 | -3.48 | -7.39 | -26.17 |
| Natural Gas (CME) | 3.546 | 2.54 | -2.93 | 20.08 |
| Heating Oil (CME) | 167.83 | -3.19 | -7.04 | -18.85 |
| Gasoline (CME) | 130.4 | -1.98 | -5.94 | -27.39 |
| Brent Crude (ICE) | 52.16 | -4.24 | -8.87 | -22.00 |
| Gas Oil (ICE) | 504.75 | -1.80 | -4.85 | -16.12 |
| ECX EUA (ICE) | 25.01 | -0.68 | 1.58 | 205.75 |
| ECX CER (ICE) | 0.24 | 0.00 | -4.00 | 41.18 |

| Agriculture (%) | | | | |
|---------------------|--------|-------|-------|--------|
| 구분 | 전일종가 | 전일비 | 1wk | YTD |
| Corn (CME) | 374.5 | 0.33 | -1.90 | 6.77 |
| Wheat (CME) | 510.5 | 0.10 | -2.30 | 19.56 |
| Soybean (CME) | 882.5 | -0.06 | -3.34 | -8.24 |
| Soybean Oil (CME) | 27.63 | -0.07 | -3.80 | -16.93 |
| Soybean Meal (CME) | 308.3 | 0.13 | -1.19 | -2.68 |
| Oats (CME) | 273.5 | -0.73 | -4.54 | 13.49 |
| Rough Rice (CME) | 10.23 | -1.25 | -3.67 | -14.07 |
| Live Cattle (CME) | 123.95 | 0.98 | 1.39 | 1.97 |
| Feeder Cattle (CME) | 146.65 | 0.60 | 1.65 | 2.79 |
| Lean Hogs (CME) | 60.575 | 0.33 | -3.39 | -15.60 |
| Cocoa (ICE) | 2373 | -2.31 | 2.42 | 25.42 |
| Cotton No2 (ICE) | 72.06 | -1.96 | -6.06 | -8.36 |
| Coffee C (ICE) | 101.75 | -2.07 | 0.89 | -19.37 |
| Sugar No11 (ICE) | 12.25 | -1.13 | -1.76 | -19.20 |
| FCOJ-A (ICE) | 124.6 | -2.43 | -7.64 | -8.95 |

| Metal (%) | | | | |
|----------------|--------|-------|-------|--------|
| 구분 | 전일종가 | 전일비 | 1wk | YTD |
| GOLD (CME) | 1281.1 | 0.64 | 1.97 | -2.15 |
| Silver (CME) | 15.31 | 1.24 | 3.32 | -10.70 |
| Platinum (CME) | 801.4 | -0.43 | 0.04 | -14.59 |
| H-G Copper | 266.8 | -1.19 | -1.77 | -19.16 |

| Commodity Index (%) | | | | |
|---------------------|---------|-------|-------|--------|
| 구분 | 전일종가 | 전일비 | 1wk | YTD |
| RJ-CRB | 170.49 | -1.42 | -3.25 | -12.06 |
| RICI 종합 | 2205.83 | -0.60 | -2.99 | -7.41 |
| RICI 에너지 | 314.23 | -2.59 | -6.91 | -9.79 |
| RICI 금속 | 1958.34 | 0.26 | 0.43 | -10.31 |
| RICI 농산물 | 762.97 | 0.87 | -1.24 | -4.99 |

Bloomberg / 한국투자증권

V. Economic Indicator / 경제지표 및 이벤트 일정

| 일시 | 시간 | 국가 | 지표/이벤트 | 기간 | 예상 | 발표 | 이전 |
|------------|-------|----|-----------------------------|--------|--------|----|--------|
| 12/28/2018 | 22:00 | GE | CPI (전월대비) | Dec P | 0.30% | -- | 0.10% |
| 12/28/2018 | 22:00 | GE | CPI (전년대비) | Dec P | 1.90% | -- | 2.30% |
| 12/28/2018 | 23:45 | US | 시카고 구매자협회 | Dec | 60.3 | -- | 66.4 |
| 12/28/2018 | | US | 순 수출 매출 옥수수-총 | 20-Dec | -- | -- | 2517 |
| 12/28/2018 | | US | 순 수출 매출 대두-총 | 20-Dec | -- | -- | 2963.4 |
| 12/28/2018 | | US | 순 수출 매출 소맥-총 | 20-Dec | -- | -- | 313.6 |
| 12/29/2018 | 0:00 | US | 미결주택매매(전월대비) | Nov | 1.00% | -- | -2.60% |
| 12/29/2018 | 0:00 | US | 미결주택매매(원지수, 전년대비) | Nov | -- | -- | -4.60% |
| 12/29/2018 | 0:30 | US | EIA 가동 천연가스 내재 흐름 | 21-Dec | -48 | -- | -141 |
| 12/29/2018 | 0:30 | US | EIA 천연가스 비축량 변동 | 21-Dec | -48 | -- | -141 |
| 12/29/2018 | 1:00 | US | DOE 미국 원유 재고 | 21-Dec | -3400k | -- | -497k |
| 12/29/2018 | 1:00 | US | DOE 쿠싱 OK 원유 재고 | 21-Dec | -- | -- | 1091k |
| 12/29/2018 | 1:00 | US | DOE 미국 휘발유 재고 | 21-Dec | 1000k | -- | 1766k |
| 12/29/2018 | 1:00 | US | DOE 원유 내재 수요 | 21-Dec | -- | -- | 19094 |
| 12/29/2018 | 3:00 | US | 베이커휴즈 미국 로터리 가스 시추공 | 28-Dec | 197 | -- | 197 |
| 12/29/2018 | 3:00 | US | 베이커휴즈 미국 로터리 석유 시추공 | 28-Dec | 881 | -- | 883 |
| 12/29/2018 | 3:00 | US | Baker Hughes U.S. Rig Count | 28-Dec | 1078 | -- | 1080 |
| 12/31/2018 | 10:00 | CH | 비제조업 PMI | Dec | 53.1 | -- | 53.4 |
| 12/31/2018 | 10:00 | CH | 제조업 PMI | Dec | 50 | -- | 50 |

- 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.