

Futures/FX Daily

해외투자영업부
2020.03.31 (화)

[24hr DESK: 1577-1282]

I. Global Market / 글로벌 마켓

주요국 주가지수

구분	전일종가	전일비(%)	1wk(%)	YTD(%)
미국 DOW	22,327.48	3.19	20.09	-21.76
미국 NASDAQ	7,774.15	3.62	13.32	-13.36
미국 S&P500	2,626.65	3.35	17.40	-18.70
영국 FTSE	5,563.74	0.97	11.41	-26.23
DJ Euro STOXX 50	2,765.62	1.35	11.27	-26.15
일본 NIKKEI	19,084.97	-1.57	13.01	-19.33
홍콩 Hang Seng	23,175.11	-1.32	6.82	-17.79
KOSPI	1,717.12	-0.04	15.83	-21.87

Market Review

■ 글로벌 증시 - 뉴욕증시, 뉴욕증시 3% 넘는 반등, 변동성 지수 여전히

뉴욕 증시가 코로나19 백신 개발 기대감과 정부의 현실적 대응으로 투자 심리가 개선되면서 3% 넘는 반등에 성공했다. 다만, 여전히 변동성지수(VIX)는 높아 시장의 급등락에 주의가 필요하다는 조연이다. 30일(현지시간) 다우지수는 전장 대비 690.70포인트(3.19%) 상승한 22327.48을 기록했다. 스탠다드앤amp;포어스(S&P)500 지수는 85.18포인트(3.35%) 오른 2626.65, 나스닥 지수 역시 271.77포인트(3.62%) 뛴 7774.15로 거래를 마쳤다.

이로써 다우는 지난주 월요일(23일) 저점보다 20% 올랐다. S&P와 나스닥도 저점보다 각각 17%, 13% 넘게 상승했다. 특히 S&P 500 지수는 지난 5거래일 중 4일이나 3% 넘게 상승했다. 그러나 지난 달 기록한 사상 최고가에 비하면 여전히 22.4% 낮다. 또한 중소기업 주식들을 나타내는 러셀 2000 지수는 1158.10으로 26.11포인트(2.31%) 올랐다.

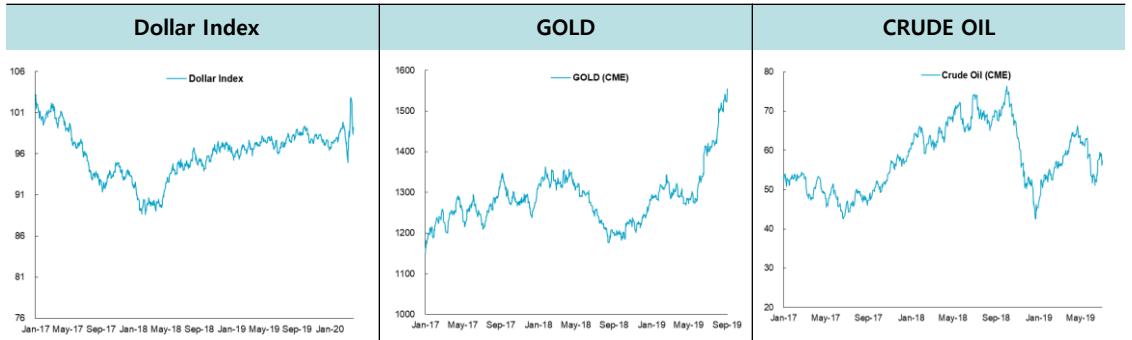
이날 증시는 코로나 백신 기대감과 미 정부의 사회적 거리두기 연장 소식에 힘입어 반등 랠리를 펼쳤다. 지난주 통화 및 재정 정책의 부양 효과가 지속되면서 증시는 상승세로 출발했다. 미 정부가 부활절(4월 12일) 경제 정상화를 포기하고 좀 더 현실적인 대응책을 내놓은 점도 투자 심리를 북돋았다. 도널드 트럼프 대통령은 전날 기자회견을 통해 '사회적 거리두기'의 가이드라인을 4월30일까지 한 달 연장하고, 6월1일까지 미국 경제를 회복시키겠다고 밝혔다.

다만, 코로나19 확산이 계속되고 있어 시장에서는 각국이 코로나19가 불러온 타격을 회복시킬 만큼 충분한 부양책을 내놓을 수 있을 것인지를 둘러싼 불확실성 때문에 거래량은 크지 않았다. 증시 변동성은 여전히하다는 점도 부담이다. 공포지수로 알려진 시카고옵션변동성(CBOE) 지수는 이날 58.74를 기록해 10거래일 만에 처음으로 60 아래로 떨어졌다. 그러나 이 지수는 여전히 평균 20을 크게 웃돌고 있다. 코로나 불확실성으로 언제든지 증시의 급등락은 재발할 수 있다. 코로나19가 전세계로 확산하며 이에 따른 봉쇄와 검역이 언제 끝날지 모르고 경제 정상화도 불분명하다.

II. Futures / 해외선물

전일 상품가격

구분	전일증가	전일비(%)	시가	고가	저가
Crude Oil	20.09	-6.60	20.93	20.93	19.27
N.Gas	1.690	1.14	1.630	1.708	1.613
Gold	1,643.2	-0.66	1,663.4	1,673.6	1,632.0
H-G Bopper	215.6	-0.76	214.7	217.5	213.6
Corn	341.25	-1.37	343.00	346.75	340.00
Wheat	569.50	-0.31	572.25	580.75	562.75
Soybean	882.25	0.09	880.00	892.50	876.75



(자료: Bloomberg, 한국투자증권)

■ Energy – 국제유가, 국제유가 또 폭락, 18년來 최저치

국제유가가 30일(현지시간) 또 폭락, 18년 만의 최저치로 떨어졌다. 이날 뉴욕상업거래소(NYMEX)에서 5월 인도분 서부 텍사스산 원유(WTI)는 전 거래일 대비 배럴당 6.6%(1.42달러) 주저앉은 20.09달러에 장을 마감했다. 2002년 2월 이후 최저 수준이다. 장중 한때 19.27달러까지 하락하며 20달러 선을 내주기도 했다. 런던 ICE 선물거래소의 5월 물 브렌트유는 배럴당 9.19%(2.29달러) 미끄러진 22.64달러에 거래 중이다. 유가는 최근 코로나19 확산 여파에 따른 원유 수요 감소와 이에 따른 사우디아라비아와 러시아 간 감산 합의 실패 이후 이어진 '유가 전쟁' 등으로 폭락세를 이어오고 있다. 유가 전쟁의 전면전은 4월부터 본격화할 전망이다. 석유수출국기구(OPEC)의 좌장 격인 사우디는 감산 기한이 끝나는 4월부터 일일 원유 수출량을 1000만배럴로, 5월부터는 사상 최대규모인 1060만배럴로 올리겠다고 공언한 상태다. 이날 도널드 트럼프 미국 대통령이 블라디미르 푸틴 러시아 대통령과 전화통화에서 유가 문제 등에 대해 논의했으나 유가 폭락을 막기엔 역부족이었다.

■ Precious Metal – 금, 미 증시 및 달러 강세에 0.7% 하락

뉴욕 금 가격은 미 증시 및 달러 강세로 0.7% 하락했다. 30일 뉴욕상품거래소에서 4월물 금 가격은 전 거래일보다 10.90달러(0.7%) 하락한 1,643.20달러에 마감했다. 지난주 급등했던 금값은 이날 증시 및 달러 강세로 인해 안전자산 수요가 약해지며 하락했다. 다만 다수의 전문가는 금 전망에 대해 낙관적이라고 평가했다. 오안다의 에드워드 모야 전략가는 "현재 전 세계는 끝나지 않는 양적완화를 받아들이고 있다"면서 "따라서 금 전망은 낙관적"이라고 전했다. 라이트 부회장 역시 "이번 주는 경제지표 충격 등으로 인해 안전자산 수요가 증가할 것"이라면서 "다음날 발표될 소비자 심리 지표는 매우 좋지 않을 것이고 목요일에 발표될 실업수당 청구건수도 328만건을 상회했을 것"이라고 분석했다.

■ Agriculture / Softs – 바이오 디젤 수요 감소 우려에 옥수수 가격 하락

국제 유가의 급락세와 코로나 바이러스에 따른 이동제한 조치 등으로 미국내 바이오 연료 수요 감소에 대한 우려가 제기되며 금일 옥수수 선물 가격은 전일대비 1%가 넘는 하락세를 기록하였다. 한편 대두는 대두박 강세와 남아프리카 지역의 선적이 지연되면서 소폭 상승하여 장을 마감하였다. 소맥은 최대 수출국인 러시아의 이동 금지 조치로 인하여 지난주 부터 견조한 흐름을 이어가고 있다.

III. FX Strategy / FX 투자전략

전일 통화쌍 가격

구분	전일증가	전일비(%)	시가	고가	저가
Dollar Index	99.181	0.83	98.45	99.32	98.29
EUR/USD	1.1048	-0.83	1.1132	1.1163	1.1010
GBP/USD	1.2414	-0.37	1.2454	1.2467	1.2318
USD/JPY	107.76	-0.17	107.95	108.29	107.12

Market Review

■ FX - 달러화, 거리두기 봉쇄 연장·낙폭 과대 속 상승

달러화 가치는 신종 코로나바이러스 감염증(코로나19) 확산을 막기 위한 미국의 사회적 거리두기 등 봉쇄 연장 조치에 안전 선호가 높아진 데다, 지난주 하락세가 가팔라 상승했다. 뉴욕 외환시장에서 주요 6개 통화에 대한 달러 가치를 반영한 달러 인덱스는 전장보다 0.74% 오른 99.125를 기록했다. 도널드 트럼프 미국 대통령이 지난 주말 코로나19 확산 억제를 위해 마련한 사회적 거리두기 지침을 4월 말까지 한 달 더 연장한다고 밝혀 안전자산 선호가 뚜렷해졌다. 트럼프 대통령은 4월 12일 부활절까지 미국 경제 활동을 정상화하겠다는 의지를 꾸준히 보였지만, 한 발짝 물러섰다. 이에 따라 달러는 주요 통화는 물론 이머징마켓 통화에도 모두 상승하고 있다. 피치의 영국 국가신용등급 강등에 파운드 가치가 달러에 다시 하락하고, 역외 중국 위안화는 중국 중앙은행의 역환매조건부채권(역RP) 금리 인하에 내리고 있다. 월말 포트폴리오 리밸런싱으로 달러 수요가 늘어난 가운데, 최근 급락에 따른 저가 매수도 나오고 있다.

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	22327.48	3.19	20.09	-21.76
미국 NASDAQ	7774.15	3.62	13.32	-13.36
미국 S&P500	2626.65	3.35	17.40	-18.70
미국 Russell 2000	1158.32	2.33	15.55	-30.58
영국 FTSE	5563.74	0.97	11.41	-26.23
프랑스 CAC40	4378.51	0.62	11.86	-26.76
독일 DAX	9815.97	1.90	12.30	-25.91
유럽 DJ Euro STOXX 50	2765.62	1.35	11.27	-26.15

ASIA Index (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
한국 KOSPI	1717.12	-0.04	15.83	-21.87
한국 KOSDAQ	542.11	3.69	22.16	-19.07
일본 NIKKEI	19084.97	-1.57	13.01	-19.33
홍콩 HangSeng	23175.11	-1.32	6.82	-17.79
홍콩 H-Share	9402.17	-1.08	7.43	-15.81
싱가폴 MSCI Singapore	1289.07	-4.54	8.83	-25.87
대만 MSCI Taiwan	370.66	-1.12	7.47	-19.94
인도 CNX Nifty	8281.10	-4.38	8.82	-31.95

Currency (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Dollar Index	99.18	0.83	-3.23	2.90
EUR/USD	1.1048	-0.83	3.00	-1.47
GBP/USD	1.2414	-0.37	7.56	-6.36
AUD/USD	0.6174	0.10	5.76	-12.06
NZD/USD	0.5978	-0.94	4.51	-11.31
USD/CHF	0.9583	0.69	-2.69	-0.86
USD/JPY	107.76	-0.17	-3.12	-0.78
USD/CAD	1.4166	1.29	-2.26	9.05

Interest Rate (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Eurodollar	99.44	0.06	-0.06	1.20
2 yr U.S. T-Notes	110.21	0.02	-0.04	2.28
5 yr U.S. T-Notes	125.41	0.18	0.04	5.73
10 yr U.S. T-Notes	138.83	0.41	0.45	8.10
30 yr U.S. T-Bonds	180.72	0.92	0.59	15.92
Euro Schatz (2yr)	112.24	0.06	0.08	0.30
Euro Bobl (5yr)	135.51	0.24	0.70	1.41
Euro Bond (10yr)	173.6	0.60	1.45	1.82

Energy (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Crude Oil (CME)	20.09	-6.60	-14.00	-67.10
Natural Gas (CME)	1.69	1.14	1.02	-22.80
Heating Oil (CME)	101.94	-4.60	0.32	-49.60
Gasoline (CME)	58.55	2.06	42.18	-65.37
Brent Crude (ICE)	22.76	-8.70	-15.80	-65.52
Gas Oil (ICE)	285.25	-5.00	-0.26	-53.54
ECX EUA (ICE)	17.06	4.09	9.78	-30.76
ECX CER (ICE)	0.25	0.00	4.17	13.64

Agriculture (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Corn (CME)	341.25	-1.37	-0.66	-11.99
Wheat (CME)	569.5	-0.31	1.24	1.92
Soybean (CME)	882.25	0.09	-0.2	-7.67
Soybean Oil (CME)	26.87	0.07	2.79	-22.72
Soybean Meal (CME)	325.5	0.74	-2.43	6.83
Oats (CME)	261.5	-1.51	-2.61	-10.45
Rough Rice (CME)	14.095	0.89	6.5	6.10
Live Cattle (CME)	89.075	-0.39	-3.73	-29.26
Feeder Cattle (CME)	120.9	-0.02	-1.51	-16.17
Lean Hogs (CME)	59.775	-6.96	-15.75	-16.31
Cocoa (ICE)	2265	0.35	0.35	-10.83
Cotton No2 (ICE)	50.7	-1.23	-2.78	-26.57
Coffee C (ICE)	119.3	2.98	-1.61	-8.02
Sugar No11 (ICE)	10.73	-3.33	-2.81	-20.04
FCOJ-A (ICE)	119.4	1.02	8.3	19.70

Metal (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
GOLD (CME)	1643.2	-0.66	4.48	7.89
Silver (CME)	14.132	-2.77	6.57	-21.14
Platinum (CME)	723.8	-2.40	15.33	-25.98
H-G Copper	215.55	-0.76	2.62	-22.94

Commodity Index (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
RJ-CRB	121.69	-1.77	-2.43	-34.50
RICI 종합	1665.75	-1.71	-0.86	-32.13
RICI 에너지	164.79	-3.85	-6.35	-57.13
RICI 금속	1847.81	-0.94	4.48	-13.75
RICI 농산물	661.46	-0.79	-0.52	-12.81

Bloomberg / 한국투자증권

V. Economic Indicator / 경제지표 및 이벤트 일정

일시	시간	국가	지표/이벤트	기간	예상	발표	이전
03월 30일	18:00	EC	경기기대지수	Mar	91.6	94.5	103.5
03월 30일	18:00	EC	산업 기대지수	Mar	-12.6	-10.8	-6.1
03월 30일	18:00	EC	서비스 기대지수	Mar	-5	-2.2	11.2
03월 30일	18:00	EC	소비자기대지수	Mar F	--	-11.6	-11.6
03월 30일	23:00	US	미결주택매매(전월대비)	Feb	-1.70%	2.40%	5.20%
03월 30일	23:00	US	미결주택매매(원지수, 전년대비)	Feb	6.50%	11.50%	6.70%
03월 30일	23:30	US	델러스 연준 제조업 활동	Mar	-10	-70	1.2
03월 31일	0:00	US	수출 검사- 옥수수	26-Mar	--	1269.07	816.63
03월 31일	0:00	US	수출 검사- 대두	26-Mar	--	413.96	570.64
03월 31일	0:00	US	수출 검사- 소맥	26-Mar	--	363.88	349.37
03월 31일	8:30	JN	실업률	Feb	2.40%	--	2.40%
03월 31일	8:30	JN	유효구인배율	Feb	1.47	--	1.49
03월 31일	8:50	JN	소매판매 (전월대비)	Feb	-1.70%	--	0.60%
03월 31일	8:50	JN	소매판매 YoY	Feb	-1.50%	--	-0.40%
03월 31일	8:50	JN	백화점, 슈퍼마켓 매출 YoY	Feb	-1.60%	--	-1.40%
03월 31일	8:50	JN	광공업생산 MoM	Feb P	0.00%	--	1.00%
03월 31일	8:50	JN	광공업생산 YoY	Feb P	-4.80%	--	-2.30%
03월 31일	10:00	CH	종합 PMI	Mar	--	--	28.9
03월 31일	10:00	CH	제조업 PMI	Mar	44.8	--	35.7
03월 31일	10:00	CH	비제조업 PMI	Mar	42	--	29.6
03월 31일	13:00	JN	자동차 생산 YoY	Jan	--	--	-8.50%
03월 31일	14:00	JN	주택착공건수 전년비	Feb	-14.70%	--	-10.10%
03월 31일	14:00	JN	연간 주택착공지수	Feb	0.826m	--	0.813m
03월 31일	14:00	JN	건설 수주 YoY	Feb	--	--	-17.00%
03월 31일	18:00	EC	CPI (전월대비)	Mar P	0.60%	--	0.20%
03월 31일	18:00	EC	CPI 예상 YoY	Mar	0.80%	--	1.20%
03월 31일	18:00	EC	CPI 근원 전년비	Mar P	1.10%	--	1.20%
04월 01일	8:50	JN	법인 대출 & 할인채 (전년대비)	Feb	--	--	2.20%
04월 01일	8:50	JN	단칸 대형 제조업 지수	1Q	-10	--	0
04월 01일	10:45	CH	차이신 중국 PMI 제조업	Mar	45	--	40.3
04월 01일	14:00	JN	자동차 판매 YoY	Mar	--	--	-10.70%
04월 01일	17:00	EC	마켓 유로존 제조업 PMI	Mar F	44.6	--	44.8
04월 01일	18:00	EC	실업률	Feb	7.40%	--	7.40%
04월 01일	20:00	US	MBA 주택용자 신청지수	27-Mar	--	--	-29.40%
04월 01일	21:15	US	ADP취업자 변동	Mar	-150k	--	183k
04월 01일	22:45	US	마켓 미국 제조업 PMI	Mar F	48	--	49.2
04월 01일	23:00	US	건설지출 전월대비	Feb	0.60%	--	1.80%
04월 01일	23:00	US	ISM 제조업지수	Mar	45	--	50.1
04월 01일	23:30	US	DOE 미국 원유 재고	27-Mar	3536k	--	1623k
04월 01일	23:30	US	DOE 미국 휘발유 재고	27-Mar	1621k	--	-1537k

●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.