

Futures / FX Daily

해외투자영업부
2020.04.01 (수)

[24hr DESK: 1577-1282]

I . Global Market / 글로벌 마켓

주요국 주가지수

구분	전일종가	전일비(%)	1wk(%)	YTD(%)
미국 DOW	21,917.16	-1.84	5.85	-23.20
미국 NASDAQ	7,700.10	-0.95	3.81	-14.18
미국 S&P500	2,584.59	-1.60	5.61	-20.00
영국 FTSE	5,671.96	1.95	4.15	-24.80
DJ Euro STOXX 50	2,786.90	0.77	2.64	-25.59
일본 NIKKEI	18,917.01	-0.88	4.56	-20.04
홍콩 Hang Seng	23,603.48	1.85	4.15	-16.27
KOSPI	1,754.64	2.19	8.99	-20.16

Market Review

■ 글로벌 증시 - 기대 웃돈 지표에도 코로나19로 경기침체 우려 지속

뉴욕증시에서 주요 지수는 신종 코로나바이러스 감염증(코로나19)으로 인한 경기침체 부담에 하락했다. 31일(이하 현지시각) 뉴욕증권거래소(NYSE)에서 다우존스30산업평균지수는 전일 대비 410.32포인트(1.84%) 떨어진 2만1917.16에, 스탠더드앤드푸어스(S&P)500지수는 42.06포인트(1.6%) 하락한 2584.59에, 기술주 중심의 나스닥 지수는 74.05포인트(0.95%) 내린 7700.10에 장을 마쳤다. S&P500 지수는 올해 1분기에 약 20% 폭락하며 지난 2008년 금융위기 이후 최악의 분기를 기록했다. 다우지수는 23.2%가량 떨어져 1987년 이후 가장 큰 폭으로 떨어졌다.

미국과 중국의 주요 지표가 예상보다 양호하게 나오면서 주요 주가지수는 장 초반에는 상승세를 보였다. 중국 국가통계국이 발표한 3월 제조업 구매관리자지수(PMI)는 전월 35.7에서 52.0으로 큰 폭 반등했다. 컨퍼런스보드가 발표한 미국의 3월 소비자신뢰지수도 120을 기록해, 110으로 고꾸라질 것이라고 본 시장 우려보다는 양호했다. 소비자신뢰지수는 지난 2월의 132.6보다는 크게 떨어졌다.

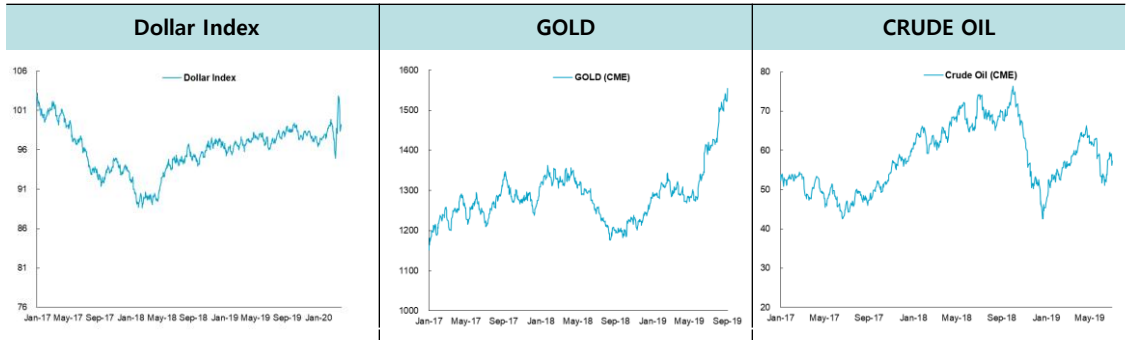
연방준비제도(Fed·연준)의 부양책도 이어졌다. 연준은 이날 해외 중앙은행과 미 국채를 담보로 한 한매조건부채권(Repo·레포) 거래를 시행하겠다는 방침을 밝혔다. 기존의 통화스와프에 더해 달러 유동성을 공급하기 위한 방안이다. 도널드 트럼프 미국 대통령은 자신의 트위터를 통해 2조 달러 규모의 인프라 투자 법안을 마련해야 한다고 촉구했다. 최근 사상 최대인 2조2000억 달러 수준의 재정 부양책을 내놨지만, 추가 부양이 필요하다는 것이다.

하지만 코로나19의 지속적인 확산과 이에 따른 글로벌 경제 침체 우려는 여전하다. 주요 지수도 이에 따라 차츰 반락한 이후 장 후반에는 낙폭을 확대했다. 미국 확진자는 18만 명을 넘어섰다. 골드만삭스는 미국 경제가 3분기에 빠르게 반등할 수 있지만, 2분기에는 34% 역성장할 것이란 경고를 내놨다. 2차 대전 후 최악의 분기 성장률이 예상된다는 것이다. 골드만삭스는 또 미국 실업률이 15%까지 오를 수 있다고 내다봤다.

II. Futures / 해외선물

전일 상품가격

구분	전일증가	전일비(%)	시가	고가	저가
Crude Oil	20.48	1.94	20.23	21.89	20.01
N.Gas	1.640	-2.96	1.702	1.731	1.636
Gold	1,596.6	-2.84	1,643.4	1,645.6	1,588.2
H-G Bopper	222.8	3.36	216.6	224.8	216.6
Corn	340.75	-0.15	341.75	344.75	333.50
Wheat	568.75	-0.13	569.75	575.25	564.25
Soybean	886.00	0.43	882.50	887.50	875.75



■ Energy – 국제유가, 혼조 마감, 원유 무한증산 폭풍전야제

(자료: Bloomberg, 한국투자증권)

전날 18년 만의 최저치를 기록했던 국제유가가 혼조세를 나타냈다. 31일(현지시간) 뉴욕상업거래소에서 5월 인도분 WTI(서부 텍사스산 원유)는 전 거래일 대비 39센트(1.9%) 오른 배럴당 20.48달러에 거래를 마쳤다. WTI는 이번 달 54% 이상의 급락을 기록했다. 5월물 북해산 브렌트유는 런던 ICE 선물 거래소에서 5센트(0.22%) 내린 22.71달러에 거래되고 있다. 국제유가는 코로나19 여파로 수요가 줄어 들고 있는 데다 주요 산유국들의 가격 인하와 증산으로 '유가 전쟁'에 나서면서 직격탄을 맞고 있다. OPEC(석유수출국기구)의 사우디아라비아와 비(非) OPEC 산유국 러시아의 증산 경쟁은 4월1일부터 전면전에 들어간다. 양측의 감산 협상 결렬로 OPEC과 비회원 산유국의 모임인 OPEC의 감산 합의가 3월 말 종료됨에 따라 앞으로 산유국들은 감산 쿼터에 제약을 받지 않고 원하는 대로 증산할 수 있게 된다. 국제에너지기구(IEA)의 파티 비롤 사무총장은 지난 26일 "세계적으로 30억명이 이동제한 상태에 놓여 있고 석유 수요는 하루 8000만배럴 수준으로 떨어질 수 있다"고 밝혔다. 그는 "국제 석유시장 안정을 위한 건설적인 대응을 호소한다"며 사우디, 러시아, 미국이 함께 감산 협의에 나서야 한다고 주장했다.

■ Precious Metal – 금, 달러 강세 등에 2.8% 하락

뉴욕 금 가격은 달러 강세 등으로 인해 2.8% 하락했다. 31일 뉴욕상품거래소에서 4월물 금 가격은 전 거래일보다 46.60달러(2.8%) 하락한 1,596.60달러에 마감했다. 금값은 이번 달에는 1.7% 올랐고 1분기에는 6% 급등했다. 이날 달러 강세가 금값에 악재로 작용했다. 주요 6개국 통화 대비 달러 가치를 나타내주는 ICE 달러지수는 0.32% 상승한 99.50에 거래되고 있다. 아바트레이드의 나일 아슬람 수석 시장 전략가는 "지표가 예상보다 훨씬 좋게 나오면서 금값 매도세를 촉발했다"면서 "금값이 1,600달러 밑으로 내려간다면 이는 추가 매수 기회"라고 평가했다. 오토가 전략가는 "금은 뚜렷한 방향성을 가리키는 촉매제가 나올 때까지 좁은 범위에서 움직일 것"이라고 덧붙였다.

■ Agriculture / Softs – 미국 농무부 주요 곡물 재고 및 2020년 파종 면적 발표

미국 농무부 USDA는 금일 연간 전망을 통해, 금년 미국내 옥수수 파종 면적이 지난 2012년 이후 최대가 될 것이라고 발표 하였다. 2020년 옥수수와 대두의 파종 면적은 각각 9699만 에이커와 8351만 에이커에 이를 것으로 집계되었고, 이는 당초 예상 면적인 옥수수 9432.8만 에이커와 대두 8486.5만 에이커를 상회하는 것으로 전해졌다..

Market Review

III. FX Strategy / FX 투자전략

전일 통화쌍 가격

구분	전일증가	전일비(%)	시가	고가	저가
Dollar Index	99.048	-0.13	99.26	99.95	98.89
EUR/USD	1.1031	-0.15	1.1048	1.1053	1.0927
GBP/USD	1.2420	0.05	1.2414	1.2473	1.2245
USD/JPY	107.54	-0.20	107.76	108.73	107.46

■ FX - 달러화, 연준 유동성 공급에 달러·美 국채 수익률 하락

금일 미 달러화와 미 국채 장기물 금리는 하락했다. 미국 연방준비제도(이하 연준)가 글로벌 달러 유동성을 높이기 위한 추가 조치를 발표한 가운데 연준의 공격적인 자산 매입과 포트폴리오 매니저들의 월말 리밸런싱을 반영했다. 달러는 연준이 미 국채를 담보로 달러화를 공급하는 레포 거래를 시행하겠다고 밝히면서 소폭 하락했다. 미국의 3월 소비자신뢰지수가 3년래 최저 수준으로 하락한 것도 달러 약세에 영향을 줬다. 주요 6개국 통화 대비 달러화 가치를 나타내는 달러인덱스는 0.2% 하락한 99.048를 나타냈다. 이날 달러 대비 유로화 가치는 1.1027달러로 0.17% 하락했다. 일본 엔화에 대해서 달러화는 달러당 107.55엔에 거래되며 0.23% 하락했다. 오전 장에서는 분기말, 일본 기업들의 회계연도 말 포트폴리오 리밸런싱으로 달러 수요가 늘었으나 상승과 하락이 번갈아 나타나며 거래가 원활하지 못했다. 지난 3월 초 전세계 금융 시장에서 나타난 매도세가 달러 강세를 촉발하면서 달러인덱스는 102.99까지 올라 3년 만에 최고치를 기록하기도 했다. 일부 전문가들은 투자자들이 다음 분기의 급격한 경기 침체를 대비하면서 달러화 가치가 계속 유지될 것으로 전망하고 있다.

Market Review

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	21917.16	-1.84	5.85	-23.20
미국 NASDAQ	7700.10	-0.95	3.81	-14.18
미국 S&P500	2584.59	-1.60	5.61	-20.00
미국 Russell 2000	1153.10	-0.45	5.16	-30.89
영국 FTSE	5671.96	1.95	4.15	-24.80
프랑스 CAC40	4396.12	0.40	3.62	-26.46
독일 DAX	9935.84	1.22	2.43	-25.01
유럽 DJ Euro STOXX 50	2786.90	0.77	2.64	-25.59

ASIA Index (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
한국 KOSPI	1754.64	2.19	8.99	-20.16
한국 KOSDAQ	569.07	4.97	18.46	-15.04
일본 NIKKEI	18917.01	-0.88	4.56	-20.04
홍콩 HangSeng	23603.48	1.85	4.15	-16.27
홍콩 H-Share	9594.77	2.05	4.47	-14.09
싱가폴 MSCI Singapore	1320.10	2.41	4.52	-24.09
대만 MSCI Taiwan	374.27	0.97	3.69	-19.16
인도 CNX Nifty	8597.75	3.82	10.21	-29.34

Currency (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Dollar Index	99.05	-0.13	-2.93	2.76
EUR/USD	1.1031	-0.15	2.25	-1.62
GBP/USD	1.2420	0.05	5.59	-6.31
AUD/USD	0.6131	-0.70	2.90	-12.68
NZD/USD	0.5956	-0.92	2.20	-11.63
USD/CHF	0.9611	0.29	-2.08	-0.57
USD/JPY	107.54	-0.20	-3.32	-0.99
USD/CAD	1.4062	-0.73	-2.77	8.25

Interest Rate (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Eurodollar	99.475	0.04	0.02	1.23
2 yr U.S. T-Notes	110.19	-0.01	0.08	2.27
5 yr U.S. T-Notes	125.36	-0.04	0.41	5.69
10 yr U.S. T-Notes	138.69	-0.10	0.90	7.99
30 yr U.S. T-Bonds	179.06	-0.92	0.12	14.85
Euro Schatz (2yr)	112.19	-0.04	0.15	0.25
Euro Bobl (5yr)	135.21	-0.22	0.71	1.18
Euro Bond (10yr)	172.51	-0.63	1.32	1.18

Energy (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Crude Oil (CME)	20.48	1.94	-14.70	-66.46
Natural Gas (CME)	1.64	-2.96	-5.15	-25.08
Heating Oil (CME)	100.15	-1.36	-7.58	-50.49
Gasoline (CME)	59.27	-3.91	16.10	-64.94
Brent Crude (ICE)	26.35	-0.26	-11.40	-60.08
Gas Oil (ICE)	292.75	2.63	-3.46	-52.32
ECX EUA (ICE)	17.68	3.63	5.36	-28.25
ECX CER (ICE)	0.25	0.00	0.00	13.64

Agriculture (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
Corn (CME)	340.75	-0.15	-1.87	-12.12
Wheat (CME)	568.75	-0.13	1.29	1.79
Soybean (CME)	886	0.43	-0.08	-7.27
Soybean Oil (CME)	27.01	0.52	1.73	-22.32
Soybean Meal (CME)	321.5	-1.23	-3.19	5.51
Oats (CME)	264.25	1.05	-1.95	-9.50
Rough Rice (CME)	14.035	-0.43	5.69	5.65
Live Cattle (CME)	92.075	3.37	-5.1	-26.88
Feeder Cattle (CME)	122.9	1.65	-5.1	-14.79
Lean Hogs (CME)	60.325	0.92	-17.36	-15.54
Cocoa (ICE)	2249	-0.71	-1.14	-11.46
Cotton No2 (ICE)	51.13	0.85	-3.33	-25.95
Coffee C (ICE)	119.55	0.21	-4.82	-7.83
Sugar No11 (ICE)	10.42	-2.89	-7.54	-22.35
FCOJ-A (ICE)	120.2	0.67	2.82	20.50

Metal (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
GOLD (CME)	1596.6	-2.84	-4.01	4.83
Silver (CME)	14.156	0.17	-0.71	-21.01
Platinum (CME)	729.9	0.84	3.99	-25.35
H-G Copper	222.8	3.36	2.20	-20.34

Commodity Index (%)				
구분	전일종가	전일비	1wk	YTD
RJ-CRB	121.79	0.08	-4.97	-34.45
RICI 종합	1667.11	0.08	-2.99	-32.08
RICI 에너지	164.32	-0.29	-9.17	-57.26
RICI 금속	1856.50	0.47	1.29	-13.35
RICI 농산물	662.01	0.08	-1.43	-12.74

Bloomberg / 한국투자증권

V. Economic Indicator / 경제지표 및 이벤트 일정

일시	시간	국가	지표/이벤트	기간	예상	발표	이전
03월 31일	8:30	JN	실업률	Feb	2.40%	2.40%	2.40%
03월 31일	10:00	CH	종합 PMI	Mar	--	53	28.9
03월 31일	10:00	CH	제조업 PMI	Mar	44.8	52	35.7
03월 31일	18:00	EC	CPI (전월대비)	Mar P	0.60%	0.50%	0.20%
03월 31일	18:00	EC	CPI 예상 YoY	Mar	0.80%	0.70%	1.20%
03월 31일	18:00	EC	CPI 근원 전년비	Mar P	1.10%	1.00%	1.20%
04월 01일	8:50	JN	단칸 대형 제조업 지수	1Q	-10	--	0
04월 01일	8:50	JN	단칸 대형 비제조업 지수	1Q	2	--	20
04월 01일	8:50	JN	단칸 대형 제조업 전망	1Q	-15	--	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	44.5	--	50.1
04월 01일	23:00	US	ISM New Orders	Mar	--	--	49.8
04월 01일	23:00	US	ISM 구매물가지수	Mar	41.6	--	45.9
04월 01일	23:00	US	ISM 고용	Mar	--	--	46.9
04월 01일	23:30	US	DOE 미국 원유 재고	27-Mar	3300k	--	1623k
04월 01일	23:30	US	DOE 쿠싱 OK 원유 재고	27-Mar	--	--	858k
04월 01일	23:30	US	DOE 미국 휘발유 재고	27-Mar	1200k	--	-1537k
04월 01일	23:30	US	DOE U.S. Distillate Inventory	27-Mar	1000k	--	-678k
04월 01일	23:30	US	DOE 원유 내재 수요	27-Mar	--	--	18885
04월 01일	23:30	US	DOE 휘발유 내재 수요	27-Mar	--	--	9672.4
04월 01일	23:30	US	DOE 증류유 내재 수요	27-Mar	--	--	5049.9
04월 01일	23:30	US	DOE 총 연료 에탄올 재고	27-Mar	--	--	24140k
04월 01일	23:30	US	DOE 연료 에탄올 총 생산	27-Mar	--	--	1005k
04월 02일	8:50	JN	본원통화 전년비	Mar	--	--	3.60%
04월 02일	8:50	JN	본원통화 기간말	Mar	--	--	¥515.9t
04월 02일	18:00	EC	PPI 전월비	Feb	-0.40%	--	0.40%
04월 02일	18:00	EC	PPI 전년비	Feb	-0.80%	--	-0.50%
04월 02일	20:30	US	Challenger Job Cuts YoY	Mar	--	--	-26.30%
04월 02일	21:30	US	무역수지	Feb	-\$40.0b	--	-\$45.3b
04월 02일	21:30	US	신규 실업수당 청구건수	28-Mar	3500k	--	3283k
04월 02일	21:30	US	순 수출 매출 원면-총	26-Mar	--	--	397.2
04월 02일	21:30	US	실업보험연속수급신청자수	21-Mar	4882k	--	1803k

●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.