

2024년 9월 3일 화요일
Grain Report

품목	월물	정산가	단위	CHG	▲%
옥수수	CU24	386.5	¢/bu	+8.50 ↑	2.2%
	CZ24	409.25	¢/bu	+8.25 ↑	2.1%
	CH25	427.25	¢/bu	+8.25 ↑	2.0%
소맥	WU24	552	¢/bu	+19.25 ↑	3.6%
	WZ24	566.75	¢/bu	+15.25 ↑	2.8%
대두	WH25	586.25	¢/bu	+14.00 ↑	2.4%
	SU24	997	¢/bu	+15.00 ↑	1.5%
	SX24	1012	¢/bu	+12.00 ↑	1.2%
대두박	SF25	1029.5	¢/bu	+12.50 ↑	1.2%
	SMU24	319.7	\$/t	+8.10 ↑	2.6%
대두유	SMV24	317.4	\$/t	+7.30 ↑	2.4%
	BOU24	42.07	¢/lb	-1.07 ↓	-2.5%
원당	BOV24	41.48	¢/lb	-1.05 ↓	-2.5%
	SBV24	19.49	¢/lb	+0.11 ↑	0.6%
	SBH25	19.81	¢/lb	+0.15 ↑	0.8%
WTI	CLU24	70.34	\$/Bbl	-3.21 ↓	-4.4%
DOW	Spot	40936.93	Index	-626.15 ↓	-1.5%
달러지수	Spot	101.825	Index	0.172 ↑	0.2%

Spread	근월물	원월물	Settle	CHG	전일
부	'SEP 24- 'DEC 24		-22.75	-22.75	0.00
	'DEC 24- 'MAR 25		-18.00	0.00	-18.00
	'MAR 25- 'MAY 25		-9.75	0.00	-9.75
	'MAY 25- 'JUL 25		-5.75	0.00	-5.75
	'JUL 25- 'SEP 25		3.00	0.00	3.00
중	'SEP 24- 'DEC 24		-14.75	-14.75	0.00
	'DEC 24- 'MAR 25		-19.50	-19.50	0.00
	'MAR 25- 'MAY 25		-11.00	-11.00	0.00
	'MAY 25- 'JUL 25		-6.25	-6.25	0.00
	'JUL 25- 'SEP 25		-11.75	-11.75	0.00
하	'SEP 24- 'NOV 24		-15.00	-22.75	7.75
	'NOV 24- 'JAN 25		-17.50	-24.50	7.00
	'JAN 25- 'MAR 25		-14.50	61.75	-76.25
	'MAR 25- 'MAY 25		-13.00	-20.00	7.00
	'MAY 25- 'JUL 25		-9.00	-14.50	5.50

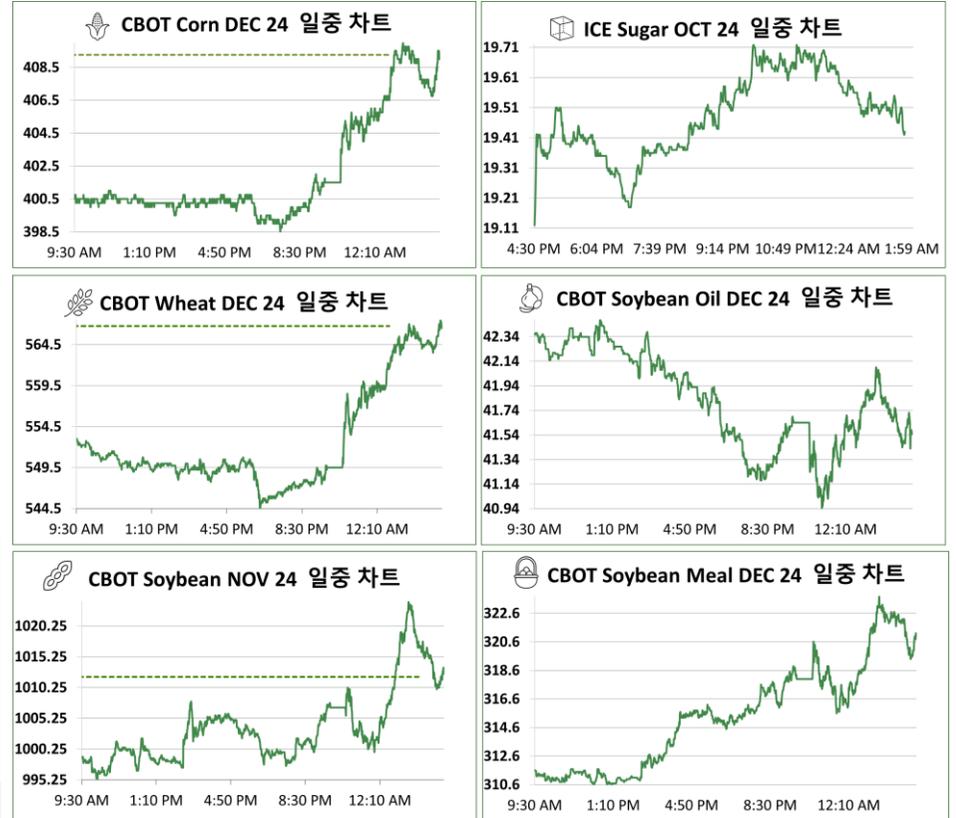
* 하이라이트 부분은 Active Month (활황물) 표시입니다.

Comment

CBOT 농산물 시장은 옥수수가 2.1%, 소맥이 2.8%의 오름세를 보이는 등 3대 품목 모두 상승 마감했다. 옥수수는 기술적 매수세가 유입되며 강세를 보였다. 또한 미 중서부 지역의 건조한 날씨로 인해 G/E Ratio가 하락할 것이라는 기대감이 있었고, 역시 가격 상승을 지지했다. 다만, USDA의 발표에 따르면 옥수수의 실제 G/E Ratio는 지난주와 동일한 65% 수준을 보였다. 소맥은 EU의 생산량이 크게 하락한 소식이 계속해서 가격 상승에 긍정적인 영향을 주고 있는 것으로 보인다. 9월 1일 기준 유럽연합의 2024/25 연도 소맥 수출량은 지난해 5.66 million metric ton 대비 하락한 4.38 million metric ton 인 것으로 확인 되었다. 대두 역시 옥수수와 마찬가지로 건조한 날씨로 인해 G/E Ratio가 하락할 것이라는 예상에 강세를 보였다. USDA가 발표한 대두의 G/E Ratio는 지난주 67%에서 2%p 하락하며, 시장의 예상에 부합하였다.

뉴욕 증시는 S&P500가 -2.1%, 나스닥이 -3.2%의 낙폭을 보이는 등 3대 지수 모두 큰 하락세를 보이며 약세 마감했다. 주요 경제 지표가 예상치를 하회하면서 경기 침체 우려가 재부각 된 것이 주요 원인이 된 것으로 보인다. ISM 8월 제조업지수는 예상치인 47.5를 하회한 47.2를 기록했고, ISM 신규 주문 지표가 이전치인 47.4에 비해 크게 하락한 44.6을 기록했다. 이러한 지표의 발표에 애플랜타 연연의 GDPnow는 3분기 전망치를 다시 2.0%로 하향 조정했다. 한편, 시장에는 BoJ의 금리 인상 가능성에 대한 소식이 전해졌고 엔화가 강세를 띄었다. 결국 엔-캐리 트레이드 청산 매물이 출회한 것으로 보이며 반도체 업종이 크게 하락했다. 엔비디아는 여기에 반독점 관련 이슈가 부각되면서 -9.5%의 하락 폭을 보였다. 마지막으로 유가는 OPEC+의 10월 증산 소식에 WTI 기준 배럴당 \$70까지 하락했다.

일중차트



본 리포트는 당사 해외사입부에 의해 신뢰할 만한 자료 및 정보로부터 작성된 것이나, 그 정확성 등을 보장할 수 없기 때문에 어떤 경우에도 고객의 선물 투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙자료로 사용될 수 없습니다. 따라서 본 자료를 참고한 고객의 투자사결정은 전적으로 고객 자신의 판단과 책임에 이루어져야 하며, 본 자료의 내용에 의거하여 행해진 투자행위 결과에 대하여 어떠한 책임도 지지 않습니다. 또한 당사의 동의 없이 본 자료를 무단으로 복제, 전송, 인용, 배포하는 행위는 법으로 금지되어 있습니다.

연중차트



품목	월물	증가	전일대비
Corn	CZ24	409.25	+4.00

품목	월물	증가	전일대비
Soybean Meal	SMV24	320.8	+0.00



품목	월물	증가	전일대비
Wheat	WZ24	566.75	+15.25

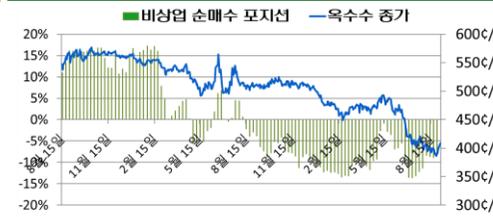
품목	월물	증가	전일대비
Soybean Oil	BOV24	40.98	+0.00



품목	월물	증가	전일대비
Soybean	SX24	1012	+12.00

품목	월물	증가	전일대비
Sugar	SBV24	19.49	+0.00

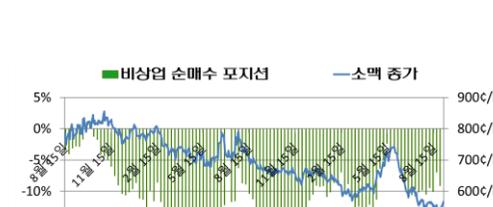
CFTC 발표 : 곡물 품목 마걸재 중 비상업 순매수 포지션 비중



기준일	펀드 비중	활황물 증가
2024-08-27	-8.42%	392.75
2024-08-20	-8.88%	398
2024-08-13	-8.56%	397.25
2024-08-06	-8.31%	405.25
2024-07-30	-11.34%	493.5
2024-07-23	-12.15%	417.25



기준일	펀드 비중	활황물 증가
2024-08-27	-16.60%	986.5
2024-08-20	-16.14%	976
2024-08-13	-15.18%	962.5
2024-08-06	-16.29%	1026.75
2024-07-30	-17.29%	1354
2024-07-23	-14.64%	1075.5



기준일	펀드 비중	활황물 증가
2024-08-27	-9.10%	535.5
2024-08-20	-6.93%	556.5
2024-08-13	-10.04%	551.75
2024-08-06	-9.44%	566.5
2024-07-30	-10.49%	674.25
2024-07-23	-9.79%	567.75



기준일	펀드 비중	활황물 증가
2024-08-27	1.49%	312.2
2024-08-20	0.58%	308.3
2024-08-13	-0.26%	299.2
2024-08-06	7.20%	326.6
2024-07-30	6.01%	393.2
2024-07-23	2.74%	319.1



기준일	펀드 비중	활황물 증가
2024-08-27	-6.50%	40.42
2024-08-20	-8.60%	39.2
2024-08-13	-9.87%	39.09
2024-08-06	-9.99%	39.96
2024-07-30	-7.48%	61.4
2024-07-23	-2.53%	45.13