

상상인 Macro Daily

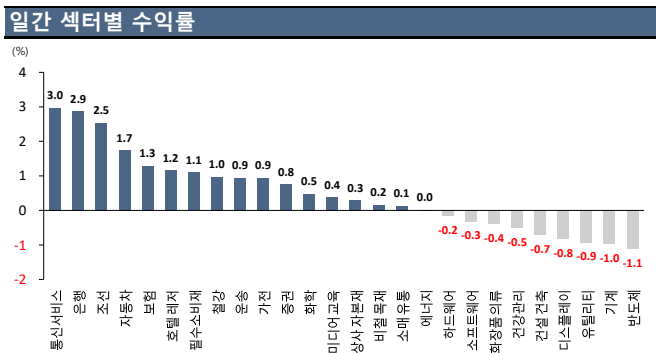
투자전략팀 / 신일, 황준호, 김현성, 최예찬 / 02 3779 3186 / jh.hwang@sangsanginib.com

2024-11-21

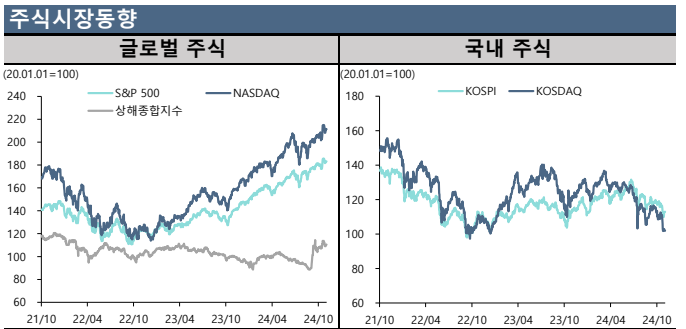
Korea Market						
Stock (pt, %)	11/20	1D	1W	1M	3M	YTD
KOSPI	2,482.3	+0.4	+2.7	-4.3	-8.0	-6.5
KOSDAQ	682.9	-0.5	-1.0	-9.3	-13.3	-21.2
반도체		-1.1	+3.7	-8.0	-26.1	-20.7
건강관리		-0.5	-1.2	-11.2	-6.4	+5.0
자동차		+1.7	+6.2	-1.4	-6.5	-1.5
화학		+0.5	-4.2	-17.8	-16.2	-42.4
소매(유통)		+0.1	-0.4	-11.0	-12.0	-18.0
미디어, 교육		+0.4	+7.8	+8.3	+8.8	-20.2
필수소비재		+1.1	+0.2	+3.5	+2.1	+9.1
거래대금 (평균, 십억원)	15,528	15,528	17,990	16,293		
외국인 순매수 (누적, 십억원)		-184	-1,486	-4,933		
기관 순매수 (누적, 십억원)		+174	+803	+1,821		
개인 순매수 (누적, 십억원)		-91	+320	+2,507		
Money Flow (십억원, Δ)						
주식형 펀드	118,479	+26	-1,621	-2,274	+1,194	+15,063
채권형 펀드	176,570	-170	-618	+3,796	+6,785	+35,124

Global Market						
Stock (pt, %)	11/20	1D	1W	1M	3M	YTD
DOW	43,408.5	+0.3	-0.8	+1.1	+5.4	+15.2
S&P 500	5,917.1	+0.0	-0.5	+1.1	+5.0	+24.1
NASDAQ	18,966.1	-0.1	-0.7	+2.1	+6.1	+26.3
유로 STOXX 50	4,729.7	-0.5	-2.1	-4.2	-3.7	+4.6
영국 FTSE 100	8,085.1	-0.2	+0.2	-2.7	-2.9	+4.5
일본 NIKKEI 225	38,352.3	-0.2	-0.5	-0.2	-0.0	+14.6
중국 상해종합	3,368.0	+0.7	-0.4	+2.5	+18.0	+13.2
VIX 지수	17.2	+5.0	+19.9	-5.7	+8.2	+37.8
MOVE 지수	106.7	+1.5	+7.3	-17.5	+1.0	-6.9

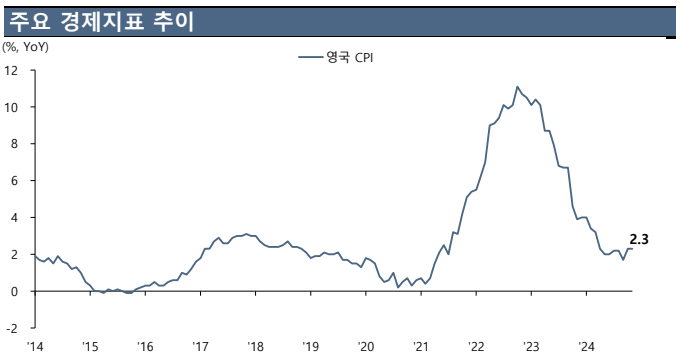
KOSPI 투자자별 매매동향			
기관 수급			
순매수 (십억원)	Daily	순매도 (십억원)	
CJ제일제당	+10.5	1 삼성전자	-14.7
하나금융지주	+10.5	2 LG생활건강	-8.8
KT	+9.2	3 롯데케미칼	-8.0
오리온	+8.7	4 한화오션	-4.7
LG화학	+8.5	5 LG디스플레이	-3.4
삼성바이오로직스	+7.9	6 효성중공업	-3.1
KB금융	+6.9	7 두산에너지리티	-2.8
외국인 수급			
순매수 (십억원)	Daily	순매도 (십억원)	
기아	+19.9	1 삼성바이오로직스	-13.3
KB금융	+19.2	2 LG화학	-11.9
LG에너지솔루션	+14.5	3 LG넥스원	-10.3
LG전자	+11.9	4 하나금융지주	-8.5
신한지주	+11.7	5 이수페타시스	-6.4
LG유플러스	+11.0	6 한국가스공사	-5.0
하이브	+10.3	7 가온전선	-4.9



Daily Comment	
Stock Market	Fixed Income
- KOSPI는 전일대비 0.42% 상승한 2,482.29pt에 마감. 엔비디아의 실적 발표를 앞두고 어닝 서프라이즈 기대감에 HBM 관련 종목들이 동반 상승한 것이 호재로 작용. 여기에 밸류업 펀드 투자 개시 소식에 따른 기대감으로 금융, 통신, 음식료 섹터가 상승한 것이 추가적인 상승 모멘텀 제공	- 국고채 10년물 금리는 전일대비 2.2bp 하락한 3.013%에 마감. 변동성이 제한된 가운데, 차주 예정된 금통위를 앞두고 외국인 투자자들을 중심으로 순매수세가 유입되면서 전반적으로 국고채 시장은 강세장 형성
- S&P 500은 전일대비 0.00% 상승한 5,917.11pt에 마감. 장 마감 이후 발표되는 엔비디아 실적 발표를 앞두고 호실적 기대감이 증시 상방압력으로 작용하였으나, 러시아-우크라이나 확전 가능성은 증시 상단을 제한하며 보합 마감	- 미국채 10년물 금리는 전일대비 1.4bp 상승한 4.410%에 마감. 주요 매크로 지표 발표가 부재한 가운데 미 국채 20년물 입찰 수요가 매우 약한 것으로 확인되면서 미 국채 금리는 하락 마감
Currency	Commodity
- 원/달러 환율은 전일대비 7.9원 상승한 달러당 1,400.9원에 마감. 정규장 이후 우크라이나 주재 미 대사관 임시 폐쇄 및 직원 대피 소식에 위험 회피 심리가 부각. 달러원 환율은 상승 마감	- 금(12월물)은 전일대비 0.87% 상승한 온스당 2,653.8달러에 마감. 우크라이나의 장거리 미사일 발사 허가 이후 러시아 본토 공격이 증가함에 따라 지정학적 우려 확대. 금 가격은 상승세를 시현
- 달러 인덱스는 전일대비 0.44pt 상승한 106.64pt에 마감. 우크라이나가 미국에 이어 영국에 장거리 미사일을 활용하면서 확전 우려가 높아진 상황. 이에 안전자산인 달러화는 상승세를 시현	- WTI(12월물)은 전일대비 0.75% 하락한 배럴당 68.87달러에 마감. 우크라이나 수도 키예우에 대한 공습 정보에 각국 대사관이 임시 폐쇄했다는 소식에 장초반 상승흐름을 나타냈으나, 이후 미국 원유 재고 증가 소식에 상승폭을 반납

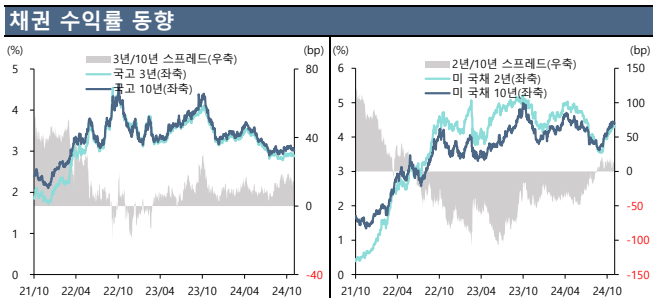


경제지표					
DATE	국가	지표	예상	실제	이전
11/20 16:00	UK	CPI (전월대비)	0.5%	0.6%	0.0%
11/20 16:00	UK	CPI (전년대비)	2.2%	2.3%	1.7%
11/20 16:00	UK	CPI 근원 전년비	3.1%	3.3%	3.2%
11/20 21:00	US	MBA 주택융자 신청지수	--	1.7%	0.5%
11/21 22:30	US	신규 실업수당 청구건수	220k	--	217k
11/22 00:00	US	선행지수	-0.3%	--	-0.5%
11/22 00:00	US	기존주택매매	3.95m	--	3.84m
11/22 08:30	JN	전국 CPI (전년대비)	2.3%	--	2.5%
11/22 09:30	JN	지분 은행 일본 PMI 제조업	--	--	49.2
11/22 16:00	UK	소매판매 (자동차연료 포함) MoM	-0.3%	--	0.3%
11/22 17:30	GE	HCOB 독일 제조업 PMI	43	--	43
11/22 18:00	EC	HCOB 유로존 제조업 PMI	46	--	46
11/22 18:30	UK	S&P 글로벌 영국 제조업 PMI	50	--	49.9
11/22 18:30	UK	S&P 글로벌 영국 서비스업 PMI	52	--	52
11/22 23:45	US	S&P 글로벌 미국 제조업 PMI	48.9	--	48.5
11/23 00:00	US	미시간대학교 소비자신뢰	73.9	--	73
11/25 18:00	GE	IFO 기업환경	--	--	86.5

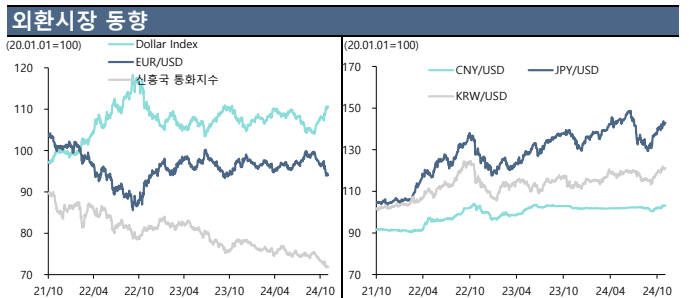


1) US=미국, SK=한국, UK=영국, AU=호주, JN=일본, CH=중국, FR=프랑스, GE=독일, EC=유로존

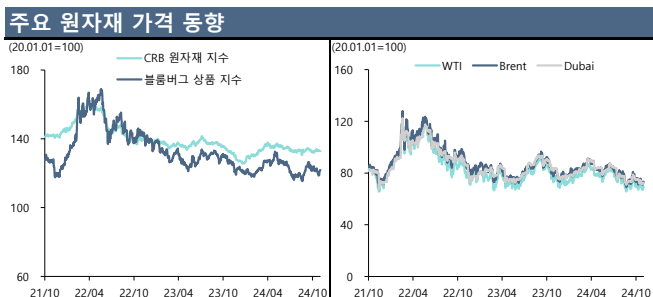
Fixed Income						
국내 채권 (% , bp)	11/20	1D	1W	1M	3M	YTD
한국 CD(91일)	3.440	+0.0	+0.0	+5.0	-7.0	-39.0
한국 CP	3.530	+0.0	+1.0	+3.0	-6.0	-74.0
통안채 1년	2.835	-0.6	-1.6	-1.0	-18.0	-55.2
국고채 3년물	2.875	-1.2	-6.7	-3.0	-3.0	-27.0
국고채 5년물	2.920	-1.5	-6.5	-4.5	-1.5	-23.5
국고채 10년물	3.013	-2.2	-4.9	-4.4	+3.1	-16.2
한국 회사채 3년물(AA-)	3.436	-1.2	-7.1	-4.0	+1.2	-45.3
해외 채권 (% , bp)	11/20					
Libor 3M	4.854	-0.1	+0.0	+0.0	-9.1	-13.2
미 국채 2년물	4.314	+3.4	-3.0	+28.2	+39.9	+6.4
미 국채 10년물	4.410	+1.4	-2.5	+20.2	+61.1	+53.1
미 국채 30년물	4.598	+1.6	+1.1	+10.1	+50.7	+56.9
미국 회사채 IG	5.204	+5.2	-4.9	+14.0	+33.8	+14.5
미국 회사채 HY	7.454	+3.7	+4.3	+1.3	-10.4	-34.4
독 국채 10년물	2.351	+1.3	+1.0	+3.3	+12.6	+32.7



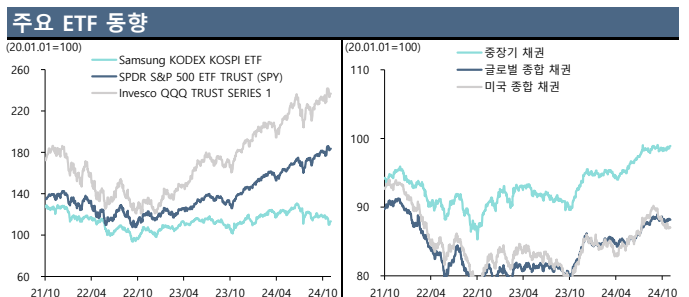
Currency						
Global Market (pt, %)	11/20	1D	1W	1M	3M	YTD
Dollar Index	106.64	+0.41	-0.03	+2.47	+5.88	+5.24
EM 무역가중 Dollar Index	137.09	-0.27	-0.27	+1.67	+3.57	+8.38
신중국 통화지수	44.157	-0.31	+0.02	-2.11	-4.44	-8.27
EURUSD	1.0540	-0.01	+0.09	-2.40	-5.83	-4.57
USDCNY	7.194	+0.03	-0.04	+1.00	+0.81	+1.56
USDJPY	155.42	+0.00	-0.54	+2.87	+7.65	+10.31
GBPUSD	1.2653	+0.00	-0.10	-2.55	-4.25	-0.58
AUDUSD	0.6504	-0.02	+0.77	-2.66	-4.28	-4.54
원화기준 (원, %)	11/20					
KRW/USD	1,400.9	-0.56	-0.11	+5.49	+5.49	+8.77
KRW/CNY	193.2	-0.43	-0.47	+3.67	+3.67	+6.27
KRW/EUR	1,472.8	+0.04	-0.62	-0.69	-0.69	+3.04
KRW/JPY	9.00	+0.04	+0.07	-1.93	-1.93	-2.07
KRW/GBP	1,771.2	-0.29	-0.34	+1.02	+1.02	+7.76
KRW/AUD	910.9	+0.01	+0.58	+0.96	+0.96	+3.58



Commodity						
에너지(%)	11/20	1D	1W	1M	3M	YTD
WTI(NYM, USD/bbl)	68.87	-0.7	+0.2	-4.5	-8.0	-3.9
브렌트유(ICE, USD/bbl)	73.08	-0.3	+0.7	-3.9	-7.5	-5.1
천연가스HH(NYM, USD/MMBtu)	3.22	+7.6	+15.5	+39.2	+59.1	+28.0
천연가스TTF(ICE, EUR/Mwh)	46.80	+2.5	+1.2	+15.0	+26.9	+44.7
산업금속(%)						
리튬(NYM, USD/ton)	8,731.0	+0.0	+1.5	-8.7	-20.1	-47.3
구리(CMX, USD/lb)	415.4	+0.3	+1.6	-5.2	-1.1	+6.8
철광석(SGX, USD/ton)	101.9	-2.0	+1.3	-1.8	+4.4	-25.3
니켈(LME, USD/ton)	15,697.4	+0.9	+2.1	-2.8	-5.5	-4.5
알루미늄(LME, USD/ton)	2,627.2	+1.4	+5.5	+0.5	+3.3	+11.7
귀금속(%)						
금(CMX, USD/t.oz)	2,653.8	+0.9	+3.1	-3.3	+5.8	+28.1
은(CMX, USD/t.oz)	31.0	-1.0	+1.3	-11.7	+3.8	+28.5
백금(NYM, USD/t.oz)	965.8	-1.2	+2.3	-6.5	-0.0	-2.9
팔라듐(NYM, USD/t.oz)	1,026.0	-1.1	+10.8	-5.1	+8.9	-7.5
곡물(%)						
대두(CBT, Usc/bsh)	991.0	-0.8	+0.5	-0.1	+4.1	-23.4
옥수수(CBT, Usc/bsh)	430.3	+0.7	+2.7	+3.3	+17.0	-8.7
소맥(CBT, Usc/bsh)	552.3	+0.5	+4.1	-4.1	+10.0	-12.1
운임(pt, %)						
BDI	1,627.0	-7.3	-3.8	+9.9	-7.7	-22.3
SCFI	2,251.9	-3.4	-3.4	+9.2	-27.3	+28.0



ETF							
국내주식(원, %)	티커	11/20	1D	1W	1M	3M	YTD
KOSPI	226490	25,420	+0.4	+2.5	-3.4	-7.7	-4.7
KOSPI 200	102110	33,040	+0.0	+3.5	-3.9	-10.3	-6.9
KOSDAQ 150	229200	11,645	-0.8	-0.9	-6.4	-10.3	-16.3
해외주식(USD, %)							
S&P 500	SPY	590.5	+0.0	-0.5	+1.2	+5.4	+25.4
NASDAQ 100	QQQ	503.2	-0.1	-1.1	+1.5	+5.0	+23.4
Stoxx 50	FEZ	47.8	-0.5	-1.0	-6.1	-8.8	+2.5
CSI 300	ASHR	27.5	+0.2	-0.7	-1.9	+16.3	+14.8
국내채권(원, %)							
중장기 채권	302190	52,085	+0.1	+0.3	+0.8	+0.5	+3.5
단기 채권	214980	112,545	+0.0	+0.0	+0.2	+0.8	+3.2
종합 채권(AA-)	273130	114,815	+0.1	+0.3	+0.8	+0.9	+4.5
종합 채권(A-)	385540	114,815	+0.1	+0.3	+0.8	+0.9	+4.5
해외채권(USD, %)							
글로벌 채권	BNDX	49.9	-0.1	+0.0	+0.0	+0.4	+3.0
US 종합 채권	AGG	97.8	-0.1	+0.1	-0.8	-2.0	+1.6
US 종합 국채	GOVT	22.6	-0.2	+0.2	-0.8	-2.3	+0.9
US 물가연동채	TIP	107.8	-0.0	+0.4	-0.7	-1.2	+2.5
기타(USD, %)							
로보틱스&AI	BOTZ	32.7	-0.3	+0.4	+3.3	+2.7	+15.0
항공&방산	ITA	151.7	+0.5	+0.3	+0.8	+4.9	+20.5
캐시카우	COWZ	59.2	+0.7	-0.7	+2.5	+3.3	+15.5



Compliance Notice
 본 자료에 기재된 내용들은 작성자 본인의 의견을 정확하게 반영하고 있으며 외부의 부당한 압력이나 간섭 없이 작성되었음을 확인합니다.
 본 자료는 고객의 증권투자를 돕기 위한 정보제공을 목적으로 제작되었습니다. 본 자료에 수록된 내용은 당사 리서치센터가 신뢰할 만한 자료 및 정보를 바탕으로 작성한 것이나, 당사가 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없으므로 참고자료로만 활용하시기 바라며 유가증권 투자 시 투자자 자신의 판단과 책임하에 최종결정을 하시기 바랍니다. 따라서 본 자료는 어떠한 경우에도 고객의 증권투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙자료로 사용될 수 없습니다. 본 자료는 당사의 저작물로서 모든 저작권은 당사에게 있으며 어떠한 경우에도 당사의 동의 없이 복제, 배포, 전송, 변형될 수 없습니다. 동 자료는 제공시점 현재 기관투자자 또는 제3자에게 사전 제공한 사실이 없습니다.