

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD012	1106.60	▼0.4	3.0	781,686
USD101	1106.10	▼0.8	2.9	11,892
USD/KRW	1106.20	▼0.3	3	
USD/CNY	6.5708	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

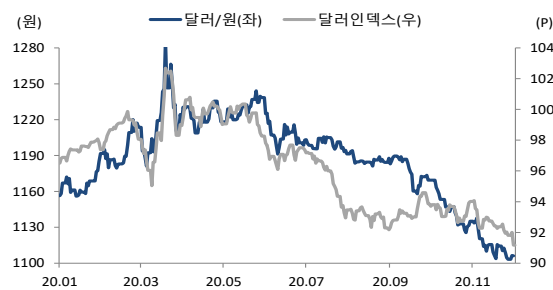
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	91.015	-0.854	UST2Y	0.1584
EUR/USD	1.2115	0.0044	UST10Y	0.9360
USD/JPY	104.42	0.09	UST30Y	1.6856
GBP/USD	1.3365	-0.0055	WTI	44.96

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(12/02)	금 일(12/03)	익 일(12/04)
19:00 유로존 10월 PPI YoY(결과:-2.0%, 이전:-2.4%)	09:30 일본 11월 서비스업 PMI(F)(예상:-, 이전:46.7)	09:30 호주 10월 소매판매 MoM(예상:0.5% 이전:-1.1%)
21:00 미국 11월 ADP 취업자 변동(결과:307k, 이전:365k)	10:45 중국 11월 차이인 서비스업 PMI(예상:56.4, 이전:56.8)	16:00 독일 10월 공장수주 MoM(예상:1.5% 이전:0.5%)
	17:55 독일 11월 마켓 서비스업 PMI(F)(예상:46.2, 이전:46.2)	18:30 영국 11월 마켓 건설 PMI(예상:52.0, 이전:53.1)
	18:00 유럽 11월 마켓 서비스업 PMI(F)(예상:41.3, 이전:41.3)	22:30 미국 11월 비농업부문 고용자수(예상:486K, 이전:638K)
	19:00 유럽 10월 소매판매 MoM(예상:0.7%, 이전:-2.0%)	22:30 미국 11월 실업률(예상:6.8%, 이전:6.9%)
	22:30 미국 주간 신규설업수당청구건수(예상:775K, 이전:778K)	00:00 미국 10월 제조업수주(예상:0.8% 이전:1.1%)
(12/03)	00:00 미국 11월 ISM 서비스업 PMI(예상:55.9, 이전:56.6)	00:00 미국 10월 내구재주문(F)(예상:1.3% 잠정:1.3%)
00:30 미국 DOE 주간 원유재고(결과:-679k, 이전:-754k)		

## 美 증시 최고치&장기 금리 급등

금일 달러/원 예상 : 1,098.00~1,106.00

NDF 최종호가 : 1,100.20/1,100.80(-0.45)

야간달러선물 증가 : 1,101.60원 | 고가:1,103.30원 | 저가:1,101.60원

### 전일 국내 동향

전일 대비 1원 내린 1105.2원에 개장한 환율은 장 초반 1105원대에서 하단이 지지되며 좁은 폭 등락하며 방향성을 탐색. 이내 글로벌 달러화가 약세폭을 키우며 91.12pt까지 하락하며 환율은 낙폭을 키움. 인민은행도 위안화 고시환율은 전장 대비 0.47% 낮게 절상 고시하며 위안화도 강세 우위인 흐름을 이어갔음. 금융시장에는 하락 재료가 우위인 가운데 환율은 1100.2원까지 저점을 낮춤. 1100원 초반에서 빅피겨 붐괴를 앞두고 외환당국의 미세조정을 통한 실개입으로 추정되는 물량과 저가 매수세가 유입. 환율은 하단이 지지되며 하락세가 되돌려지는 듯 했으나, 반락에 전일 대비 5.4원 내린 1100.8원에 마감.

### 전일 해외 동향

달러화는 미국 추가 부양책 시행에 대한 기대감에 뉴욕증시가 사상 최고치를 재경신하며 미국채 장기 금리 상승에 연동해 좁은 폭 등락하며 하락.

미국 민주당 상원의장 척슈머 원내대표와 펠로시 하원의장은 전일 초당파 의원들이 제안한 9080억달러 규모의 부양책 시행안이 양원 협상을 위한 토대로 사용하겠다고 밝힘. 이에 미국채 수익률은 장기물 중심으로 큰폭 상승해 미국채 벤치마크 금리 10년물을 1%대를 앞둔 수준까지 상승. 또한 파월 연준 의장이 펜데믹과 관련된 위험이 완전히 제거될 때까지 낮은 수준의 금리를 유지하고, 더는 필요없을 때까지 경기에 부양을 제공하겠다고 밝힘. 또한 영국 정부가 제약사 화이자와 바이오엔테크의 백신 사용을 공식 최초 승인한 점도 금융시장의 위험선호심리 재료가 활용. 유로화는 차주 ECB회의를 앞두고, 헝가리가 유럽 연합 예산 과 회복기금을 법률과 연계하는 방안을 추진하고 있다는 소식이 이어지며 강세.

### 금일 전망

금일 환율은 영국을 시작으로 주요국의 백신 승인과 보급에 대한 기대감으로 인한 위험선호심리, 미국과 유럽 등 국가의 부양책 시행으로 인한 인플레이션 발 글로벌 달러 약세에 하락 우위를 예상.

간잠 뉴욕증시는 미국 부양책 시행 기대감에 급등해 S&P500지수는 이틀째 사상 최고치를 재경신했으며. 국제유가는 반등을 시도. 연준 베이지북에서도 거의 모든 지역에서 고용지 증가하고 있으며, 기업 전망이 긍정적이라고 발표하며 인플레이션에 대한 기대감을 높이고 있음. 이에 전일 미국 국채 장기물 중심으로 상승해 스티프닝 추세가 뚜렷해진 상황. 이에 인플레이션 기대감으로 인한 달러화 약세와 뉴욕증시 강세 연동한 외인의 증시 순매수세 이어질 것으로 보이며 1100원대 하방 테스트 이어질 것으로 보임.

## USD Futures &amp; Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD012	1,106.60	-0.40	1,108.50	1,109.00	1,106.00	3.00	233,736	2,776	781,686	7,607
USD101	1,106.10	-0.80	1,108.60	1,108.90	1,106.00	2.90	4,422	201	11,892	-380
USD SPOT	1,106.20	-0.30	1,108.10	1,109.00	1,106.00	3.00	4,527	271	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	45,072	35,111	9,961	5,459	-81,215
은행	9,260	2,950	6,310	8,534	-23,164
투신	1,011	1,896	-885	-2,171	3,379
보험	69	742	-673	-2,676	-16,571
기타법인	7,890	5,188	2,702	5,349	-503
개인	17,947	15,561	2,386	25,112	-4,387
외국인	85,436	105,337	-19,901	-39,707	121,907

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,634.25	42.91
국고채3Y	0.979	-0.002
국고채10Y	1.641	-0.014

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	21.133	-0.126

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	785	20,053	73,890
KOSDAQ	2,653	4,428	9,113
국고채	1,840	7,190	18,215
통안채	1,001	1,931	6,830

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.15213	0.00450
Call	0.480	0.020	3M	0.23050	-0.00150
CD	0.660	0.000	6M	0.25825	-0.00050
통안1년	0.724	-0.003	12M	0.33438	0.00125

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	29,883.79	59.87	0.20	-0.54
S&P	3,669.01	6.56	0.18	0.92
나스닥	12,349.37	-5.74	-0.05	2.60
FTSE 100	6,463.39	78.66	1.23	1.13
DAX 30	13,313.24	-69.06	-0.52	0.18
Nikkei 225	26,800.98	13.44	0.05	1.92
Shanghai	3,449.38	-2.56	-0.07	2.59
항셍 H	10,573.79	-85.85	-0.81	0.15
미국채 2년	0.1584	-0.0078	-4.69	0.06
미국채 10년	0.9360	0.0100	1.08	6.17
WTI	44.96	0.41	0.92	0.11
Gold	1,826.07	13.07	0.72	0.96

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	0.20	-0.05
3M	0.35	-0.05
6M	0.40	0.00
12M	0.50	0.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.275	0.005
2Y	0.270	0.005
3Y	0.295	0.005
4Y	0.305	0.010
5Y	0.345	0.010

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

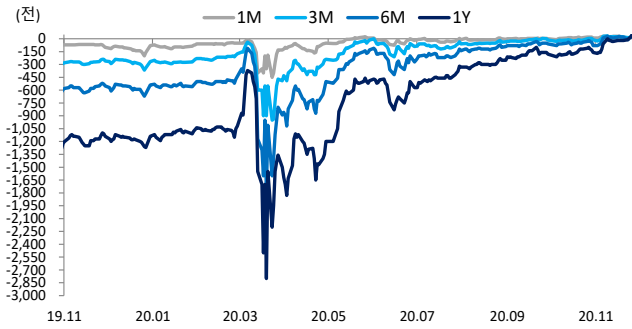
## 아시아 통화

## 기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	91.015	-0.854	-1.06	USD/KRW	1,106.15	-0.25	-0.22	USD/RUB	75.8450	-0.5494	0.39
EUR/USD	1.2115	0.0044	1.66	USD/CNY	6.5722	-0.0067	-0.10	USD/BRL	5.2183	-0.1411	-1.85
USD/JPY	104.42	0.09	-0.04	USD/HKD	7.7518	0.0000	0.01	USD/ZAR	15.3151	0.0653	1.25
GBP/USD	1.3365	-0.0055	-0.11	USD/SGD	1.3391	0.0011	-0.08	USD/MXN	19.9682	-0.0645	0.02
USD/CHF	0.8946	-0.0051	-1.51	USD/TWD	28.676	0.013	0.05	USD/PLN	3.6935	0.0067	-1.43
AUD/USD	0.7416	0.0045	0.69	USD/INR	73.67	-0.37	-0.58	USD/TRY	7.8619	0.0276	-0.84
NZD/USD	0.7070	0.0006	0.90	USD/IDR	14,130	10	-0.10	USD/SEK	8.4679	-0.0102	-0.34
USD/CAD	1.2918	-0.0018	-0.68	USD/THB	30.253	-0.007	-0.30	USD/NOK	8.8000	-0.0041	-0.32

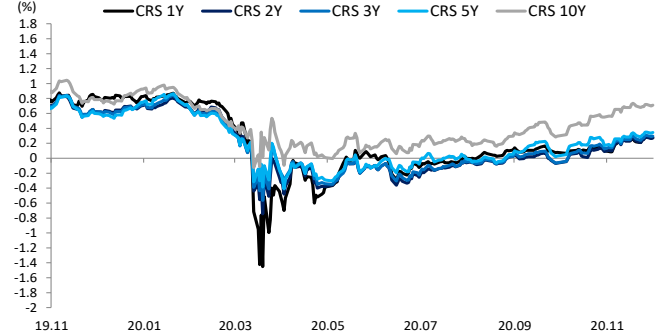
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

### 차트. FX Swap Point



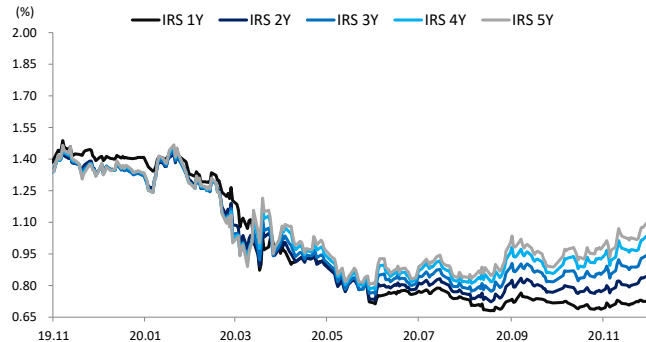
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

### 차트. CRS



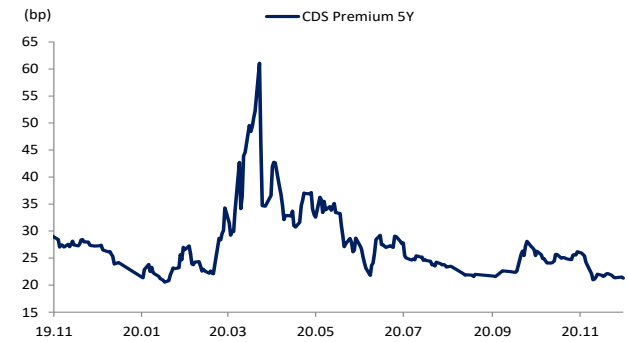
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

### 차트. IRS



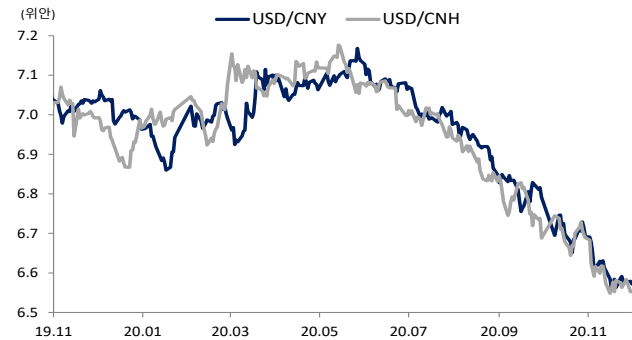
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

### 차트. CDS Premium 5Y



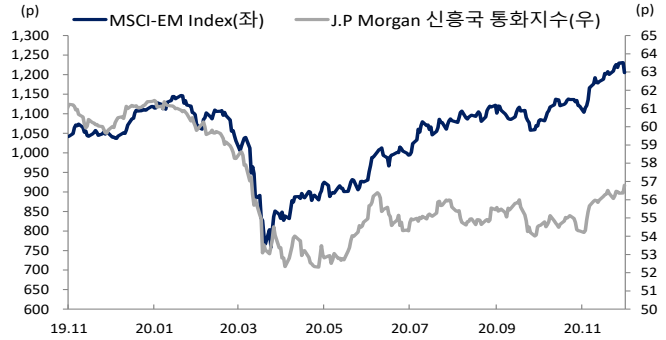
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

### 차트. 달러/위안



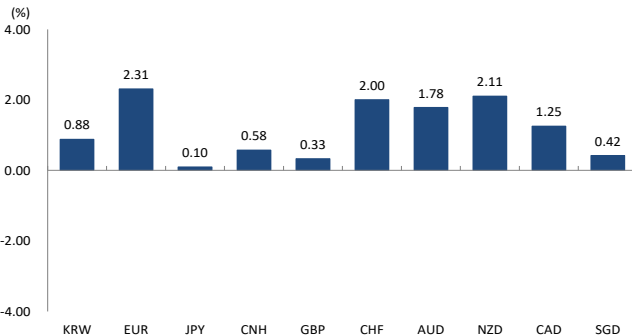
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

### 차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



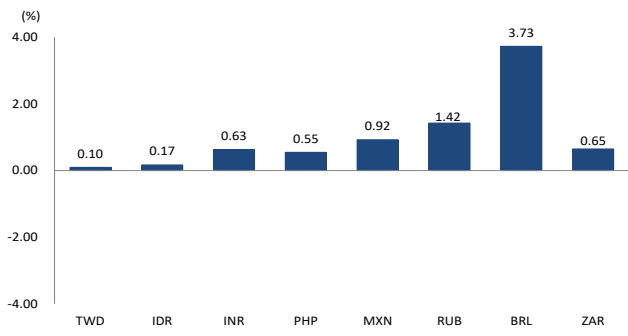
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

### 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

### 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터