

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD012	1083.00	▲1.1	4.0	806,480
USD101	1082.60	▲0.8	3.7	14,973
USD/KRW	1082.10	▲0.0	3.6	
USD/CNY	6.5412	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	90.876	0.175	UST2Y	0.1408
EUR/USD	1.2109	-0.0012	UST10Y	0.9228
USD/JPY	104.05	-0.12	UST30Y	1.6796
GBP/USD	1.3380	-0.0061	WTI	45.63

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(12/07)

16:00 독일 10월 산업생산 MoM(결과:3.2%, 이전:1.6%)
18:30 유럽 12월 센티스 투자기대지수(결과:-2.7, 이전:-10.0)

금 일(12/08)

09:30 호주 11월 NAB경기기대지수(예상:--, 이전:5)
19:00 독일 12월 ZEW 서베이 예상(예상:35, 이전:39.0)
19:00 유럽 3분기 GDP QoQ(F)(예상:12.6%, 잠정:12.6%)
20:00 미국 11월 NFIB 소기업낙관지수(예상:102.5, 이전:104.0)

의 일(12/09)

10:30 중국 11월 CPI YoY(예상:0.0%, 이전:0.5%)
10:30 중국 11월 PPI YoY(예상:-1.8%, 이전:-2.1%)
15:00 일본 11월 공작기계수주 YoY(P)(예상:--, 이전:-6.0%)
21:00 미국 MBA주택용자신청지수(예상:--, 이전:-0.6%)

미 부양책 합의 지연&브렉시트 불발

금일 달러/원 예상 : 1,080.00~1,087.00

NDF 최종호가 : 1,084.30/1,084.80(+2.40)

야간달러선물 종가 : 1,084.00원 | 고가:1,087.30원 | 저가:1,081.90원

전일 국내 동향

전 거래일 대비 0.9원 오른 1083원에 개장한 환율은 장 초반 1080.9원까지 저점에 낮췄으나, 위안화 약세 전환과 코스피 현물시장에서 외국인이 순매도세에 반등. 1080원대 레벨 하단에서 외환 당국의 강한 경계감이 지속되었음. 점심시간 간 발표한 중국 11월 수출이 큰 폭 상승하며 위안화는 강세 전환에 성공. 환율은 위안화 환율과 연동해 1080원 초반 보합권에 안착해 등락하다 전 거래일 대비 0.15원 내린 1081.9원에 마감.

이 날 발표된 11월 중국 수출지표는 전년대비 21.1%상승하며 예상치(12.0%)와 이전치(11.4%)를 큰 폭 상회했음. 중국 지표 발표 이후 코스피 현물 시장에서는 외국인이 순매수 전환해, 전기전자 중심으로 매수세를 확대.

전일 해외 동향

달러화는 브렉시트 합의 불발로 인한 파운드 급락에 따른 유로화 약세와 미국 내 코로나 확산으로 위험선호심리 후퇴되어 상승.

파운드화는 영국과 EU간 브렉시트 무역협상 합의에서 양측이 여전히 어업권과 공정경쟁규정, 합의안에 대한 관리 방식을 두고 이견이 있음을 공동성명에 서 밝힘. 이에 파운드화는 파운드당 1.325달러까지 하락하며 낙폭을 키워감. 이와 연동해 유로화도 하락해 달러화 장초반 달러화는 91p를 돌파.

뉴욕증시는 미국 내 일일 코로나 신규 확진자 7일 평균치가 19만6200명으로 사상 최고치를 경신하며 코로나 확산에 대한 우려감이 가중되어 하락. 미 국립 알레르기 전염병 연구소의 파우치 소장은 브리핑을 통해 크리스마스 시즌에 확산세가 더욱 심각해질 수 있음을 언급하며 최악의 사태가 올 것을 경고.

금일 전망

금일 환율은 글로벌 달러 강세 전환, 미중 갈등, 수도권 사회적 거리두기 격상에 강보합권 등락을 전망.

미국 추가 부양책과 관련해 여야 관료들이 여전히 합의에 이르지 못해 오는 금요일 밤으로 예정된 법안 통과 시한을 연기할 예정. 연내 대규모 부양책 타결 불활성성이 90p를 앞둔 글로벌 달러의 추가 하락세를 제한하고 있음. 뿐만 아니라 미국 트럼프 대통령이 홍콩 입법회 의원들의 자격을 박탈한 일에 연루된 중국 전인대 14명에 대한 제재 조치를 발표하며 미중 갈등이 지속되고 있는 점도 위안화 추가 하락세를 제한하는 요인. 이에 금일 환율 달러화와 위안화 등 주요 통화의 움직임 제한될 것으로 보여, 상승 우위 속 월말 제한된 거래량에 방향성 탐색 할 것으로 보임. 한편 금일부터 수도권의 사회적 거리두기가 2.5단계로 격상되면서 국내 코로나 19 확산세 주시.

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD012	1,083.00	1.10	1,082.50	1,084.70	1,080.70	4.00	226,493	-137,999	806,480	2,571
USD101	1,082.60	0.80	1,082.30	1,084.50	1,080.80	3.70	4,955	370	14,973	1,322
USD SPOT	1,082.10		1,083.00	1,084.50	1,080.90	3.60	4,333	-1,226	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	47,021	51,066	-4,045	8,057	45,142
은행	28,359	3,539	24,820	33,081	42,209
투신	1,180	3,166	-1,986	1,485	-9,227
보험	2	1,575	-1,573	-5,141	-19,657
기타법인	7,372	6,771	601	3,418	-231
개인	26,026	29,818	-3,792	14,036	15,971
외국인	151,223	165,048	-13,825	-54,736	-74,677

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,745.44	13.99
국고채3Y	0.961	-0.005
국고채10Y	1.646	-0.009

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	20.637	-0.326

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-903	14,715	41,317
KOSDAQ	980	1,616	7,300
국고채	-4,895	-4,249	8,775
통안채	2,760	3,831	8,762

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14575	-0.00600
Call	0.530	-0.050	3M	0.23038	0.00450
CD	0.660	0.000	6M	0.25313	-0.00262
통안1년	0.715	-0.005	12M	0.33825	0.00150

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	30,069.79	-148.47	-0.49	1.45
S&P	3,691.96	-7.16	-0.19	1.94
나스닥	12,519.95	55.72	0.45	2.63
FTSE 100	6,555.39	5.16	0.08	4.62
DAX 30	13,271.00	-27.96	-0.21	-0.15
Nikkei 225	26,547.44	-203.80	-0.76	0.43
Shanghai	3,416.60	-27.98	-0.81	0.73
항셍 H	10,473.32	-151.33	-1.42	-0.69
미국채 2년	0.1408	-0.0099	-6.57	-5.19
미국채 10년	0.9228	-0.0431	-4.46	10.00
WTI	45.63	-0.63	-1.36	0.64
Gold	1,865.53	26.67	1.45	4.92

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.00	-0.05
3M	0.10	-0.10
6M	0.10	-0.20
12M	0.10	-0.20

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.255	-0.020
2Y	0.265	-0.015
3Y	0.285	-0.013
4Y	0.305	-0.015
5Y	0.345	-0.015

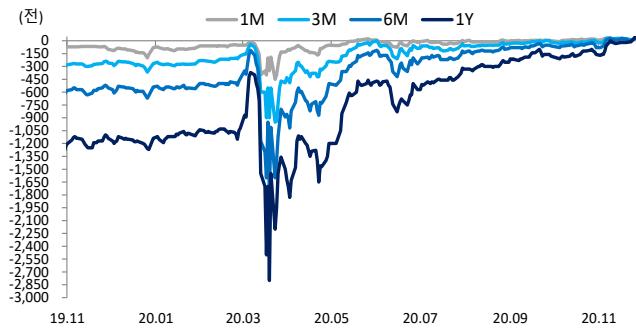
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	90.876	0.175	-1.08	USD/KRW	1,081.90	-0.15	-2.21	USD/RUB	73.6411	-0.4143	-3.60
EUR/USD	1.2109	-0.0012	1.53	USD/CNY	6.5297	-0.0018	-0.75	USD/BRL	5.1068	-0.0227	-4.71
USD/JPY	104.05	-0.12	-0.25	USD/HKD	7.7511	0.0004	-0.00	USD/ZAR	15.1465	-0.0560	-2.08
GBP/USD	1.3380	-0.0061	0.43	USD/SGD	1.3366	0.0008	-0.37	USD/MXN	19.8867	0.1193	-1.46
USD/CHF	0.8906	-0.0016	-2.01	USD/TWD	28.396	0.008	-0.93	USD/PLN	3.6925	0.0051	-1.67
AUD/USD	0.7421	-0.0004	1.05	USD/INR	73.90	0.11	#N/A	USD/TRY	7.8060	0.0049	-0.22
NZD/USD	0.7044	-0.0004	0.38	USD/IDR	14,105	0.13	-0.11	USD/SEK	8.4010	-0.0552	-2.01
USD/CAD	1.2798	0.0014	-1.56	USD/THB	30.145	-0.048	-0.38	USD/NOK	8.7427	-0.0575	-1.53

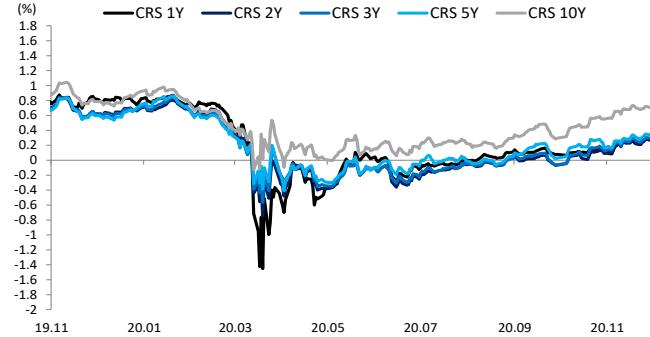
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



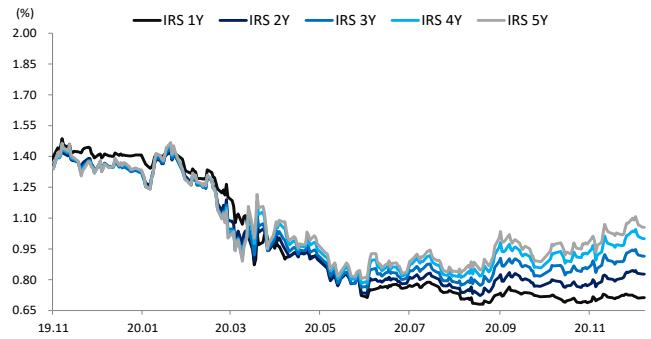
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



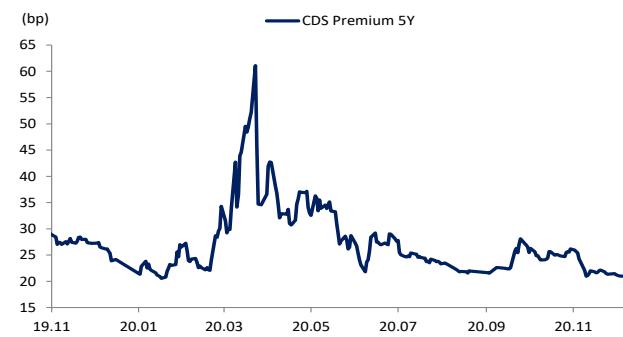
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



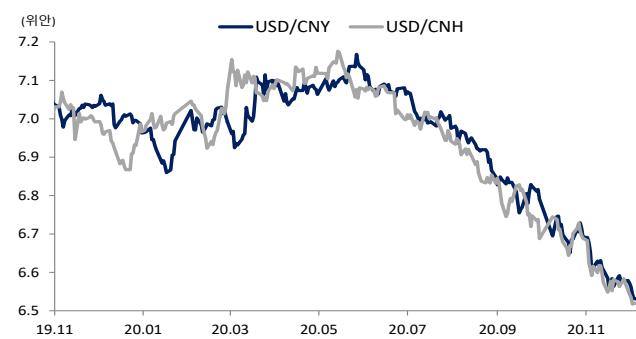
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



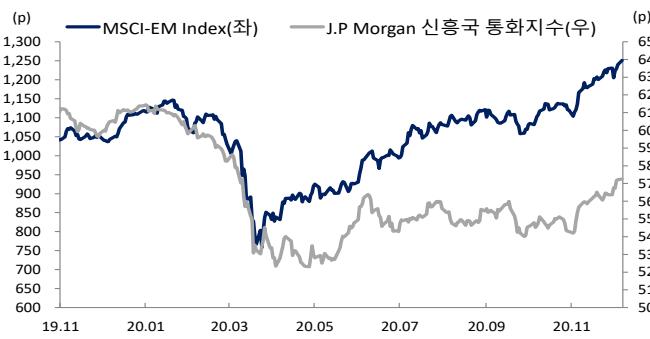
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



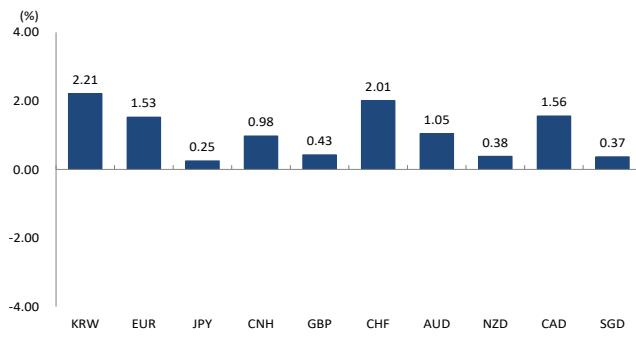
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



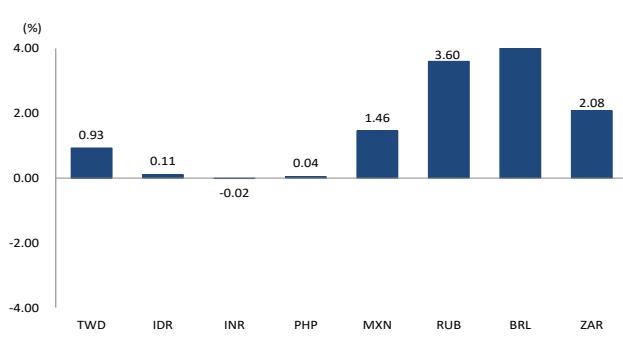
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터