

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

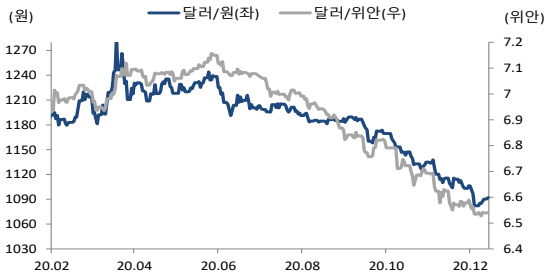
◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD012	1091.60	▲2.0	3.1	770,056
USD101	1091.50	▲2.0	2.9	87,575
USD/KRW	1091.80	▲1.5	2.9	
USD/CNY	6.5393	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	90.729	-0.247	UST2Y	0.1150
EUR/USD	1.2144	0.0032	UST10Y	0.8931
USD/JPY	104.05	0.01	UST30Y	1.6290
GBP/USD	1.3324	0.0100	WTI	47.04

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포팩스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포팩스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

금 일(12/14)	익 일(12/15)	익 일(12/16)
19:00 유럽 10월 산업생산MoM(결과:2.1%,이전:-0.4%)	11:00 중국 11월 산업생산 YoY(예상:7.0%,이전:6.9%)	08:00 한국 11월 실업률 (예상:4.2%,이전:4.2%)
	11:00 중국 11월 소매판매 YoY(예상:5.1%,이전:4.3%)	16:00 영국 11월 CPI YoY(예상:0.6%,이전:0.7%)
	16:00 영국 10월 ILO 실업률(예상:5.2%,이전:4.8%)	17:30 독일 12월 마켓 제조업 PMI(P)(예상:56.5,이전:57.8)
	22:30 미국 12월 뉴욕주 제조업 지수(예상:6.9,이전:6.3)	22:30 미국 11월 소매판매 MoM(예상:0.1%,이전:0.2%)
	23:15 미국 11월 산업생산 MoM(예상:0.3%,이전:1.1%)	23:45 미국 12월 마켓 제조업 PMI(P)(예상:55.8,이전:56.7)
(12/15)		(12/17)
02:40 미국 연준 랜달 윌스 부의장 연설		04:00 미국 FOMC 통화정책회의 기준금리 결정(예상:동결)

## 뉴욕시 섯다운vs브렉시트 합의 기대

금일 달러/원 예상 : 1,088.00~1,095.00

NDF 최종호가 : 1,092.80/1,093.30(+1.50)

야간달러선물 증가 : 1,092.90원 | 고가:1,093.50원 | 저가:1,090.70원

### 전일 국내 동향

전일 대비 1.2원 오른 1091.5원에 개장한 환율은 뉴욕지수선물이 오름폭을 키우며 글로벌 달러화는 하락 우위의 흐름을 이어갔음. 브렉시트와 미국 부양책 이슈로 인한 위험선호 회복에 코스피 증시는 강보합권에서 등락했고, 환율도 이와 연동해 1190원대 초반에서 좁은 폭 등락. 오후들어 증시에서 외국인의 순매도 규모가 늘어나며 환율은 상승 우위의 흐름을 이어갔음. 글로벌 달러 약세가 환율 하단을 상단을 지지했으나, 환율은 수급상 상승 우위의 흐름을 이어가 전일 대비 1.5원 오른 1091.8원에 마감.

### 전일 해외 동향

달러화는 장초반 브렉시트 타결 기대감에 따른 파운드화 강세에 하락 압력 있었으나, 미국 뉴욕과 영국 런던의 전면 봉쇄에 대한 우려감으로 미국 증시가 하락하자 낙폭을 되돌리며 보합권 마감.

파운드화는 영국과 EU간 무역협상을 지속하면서 노딜 브렉시트에 대한 우려감이 다소 완화되어 상승. EU바르니에 브렉시트 수습 협상 대표는 양측 협상이 진정되었고 합의는 아직 가능하다고 언급. 다만 보조금 외의 어업권에서 이견이 발생하고 있다고 전함. 이에 파운드는 장중 1.16% 상승한 1.344달러까지 고점을 높임. 이와 연동해 영국 gilt채 금리는 장기물 중심으로 상승폭을 키워 10년물 금리는 전일 대비 5.1bp상승한 0.225%까지 고점을 높임.

다만 뉴욕시의 쿠파모 주지사는 코로나 19 확산세가 현재와 같은 속도로 지속할 경우 두번째 전면적인 봉쇄에 들어갈 수 있다고 언급해 위험선호심리가 다소 되돌려지기도 했음.

### 금일 전망

금일 환율은 미국의 백신 첫 접종 소식에도 불구하고 급격하게 늘어나는 코로나 19 확진자 소식으로 인한 전면봉쇄 우려감이 부담으로 작용해 상승 우위 속 보합권 등락을 예상. 미국 뉴욕시에 이어 영국 런던이 이르면 16일부터 활동 제한 조치를 최고단계로 격상하기로 결정. 미국 백신 개발 책임자가 내년3월까지 미국 인구의 3분의 1이 백신접종으로 면역을 갖출 수 있도록 하겠다고 밝힌 만큼 백신 기대감에 따른 투심 회복은 시기상조로 보임. 다만 미국 여야 양당이 2021년 예산안의 세부내용을 조율하고 있어, 부양책 기대감은 달러화 약세로 작용에 환율 상단을 제한할 것으로 보임. 초당파 의회가 제안한 9천80억달러 부양법안 중 7480억달러는 중소기업, 실업자, 코로나 19 백신공급에 1600억달러는 정부지원으로 구분할 계획. 이에 금일 환율 엇갈린 채로 속 보합권 등락을 전망.

## USD Futures &amp; Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD012	1,091.60	2.00	1,091.50	1,092.10	1,089.00	3.10	219,544	-79,686	770,056	-23,460
USD101	1,091.50	2.00	1,091.50	1,091.90	1,089.00	2.90	7,367	-3,517	87,575	31,036
USD SPOT	1,091.80	1.50	1,091.50	1,092.10	1,089.20	2.90	5,171	-1,386	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	69,824	77,298	-7,474	12,015	257
은행	2,716	2,086	630	54,742	125,685
투신	9,742	8,961	781	-6,431	-18,363
보험	12,577	12,063	514	-1,599	-18,155
기타법인	11,891	9,186	2,705	-10,410	-10,210
개인	31,056	27,083	3,973	-20,368	1,943
외국인	152,828	153,957	-1,129	-28,649	-81,757

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,762.20	-7.86
국고채3Y	0.983	0.003
국고채10Y	1.656	-0.005

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	21.628	0.054

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-3,606	-25,693	-8,577
KOSDAQ	757	417	8,906
국고채	569	1,704	11,288
통안채	1,498	5,259	9,312

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.15313	-0.00550
Call	0.000	-0.570	3M	0.21925	0.00275
CD	0.660	0.000	6M	0.24713	-0.00162
통안1년	0.721	0.000	12M	0.33488	-0.00100

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	29,861.55	-184.82	-0.62	-0.69
S&P	3,647.49	-15.97	-0.44	-1.20
나스닥	12,440.04	62.17	0.50	-0.64
FTSE 100	6,531.83	-14.92	-0.23	-0.36
DAX 30	13,223.16	108.86	0.83	-0.36
Nikkei 225	26,732.44	79.92	0.30	0.70
Shanghai	3,369.12	21.93	0.66	-1.39
항셱 H	10,443.12	-9.38	-0.09	-0.29
미국채 2년	0.1150	0.0000	0.00	-18.32
미국채 10년	0.8931	-0.0033	-0.37	-3.22
WTI	47.04	0.47	1.01	2.80
Gold	1,828.91	-10.94	-0.59	-1.96

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	-0.25	-0.20
3M	-0.25	-0.20
6M	-0.20	-0.10
12M	-0.20	-0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.210	-0.015
2Y	0.255	-0.015
3Y	0.275	-0.015
4Y	0.295	-0.015
5Y	0.335	-0.015

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화

\*영업일 기준으로 집계

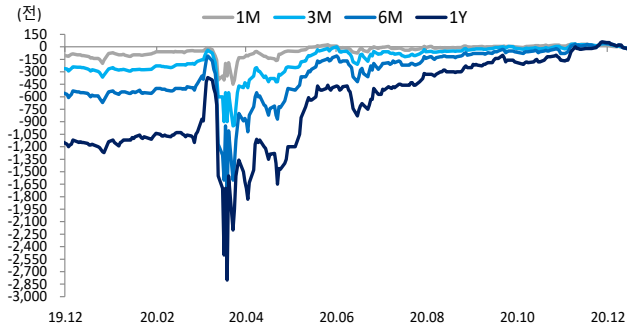
## 아시아 통화

## 기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	90.729	-0.247	-0.07	USD/KRW	1,091.60	1.50	0.90	USD/RUB	73.8789	0.9307	0.32
EUR/USD	1.2144	0.0032	0.29	USD/CNY	6.5510	0.0048	0.33	USD/BRL	5.1163	0.0569	0.19
USD/JPY	104.05	0.01	0.00	USD/HKD	7.7518	0.0005	0.01	USD/ZAR	15.0332	-0.1045	-0.75
GBP/USD	1.3324	0.0100	-0.42	USD/SGD	1.3352	-0.0016	-0.10	USD/MXN	20.2425	0.1108	1.79
USD/CHF	0.8867	-0.0035	-0.44	USD/TWD	28.296	-0.007	-0.35	USD/PLN	3.6546	-0.0178	-1.03
AUD/USD	0.7535	0.0002	1.54	USD/INR	73.56	-0.09	-0.47	USD/TRY	7.8540	0.0088	0.61
NZD/USD	0.7081	-0.0003	0.53	USD/IDR	14,095	15	-0.07	USD/SEK	8.4044	-0.0539	0.04
USD/CAD	1.2764	-0.0005	-0.27	USD/THB	30.068	0.040	-0.26	USD/NOK	8.7517	-0.0655	0.10

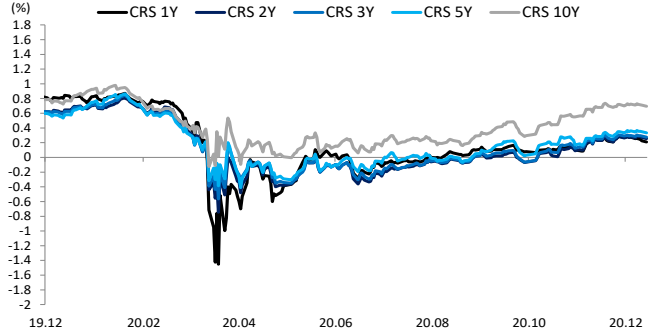
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



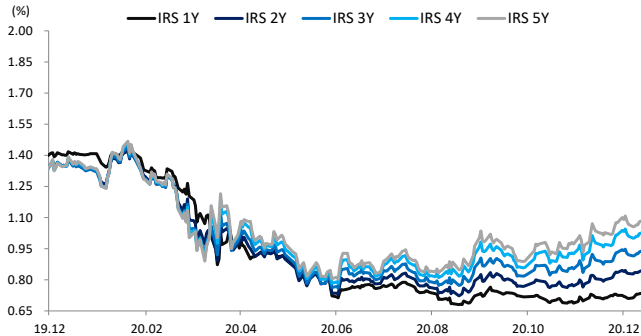
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



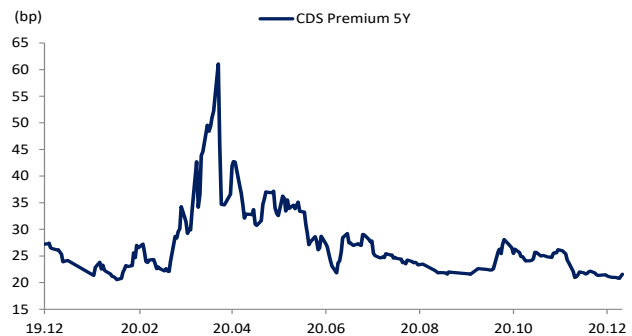
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



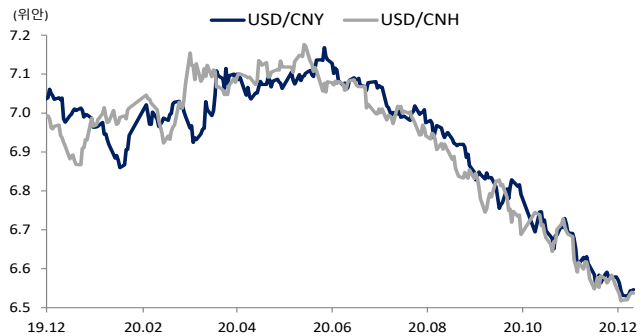
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



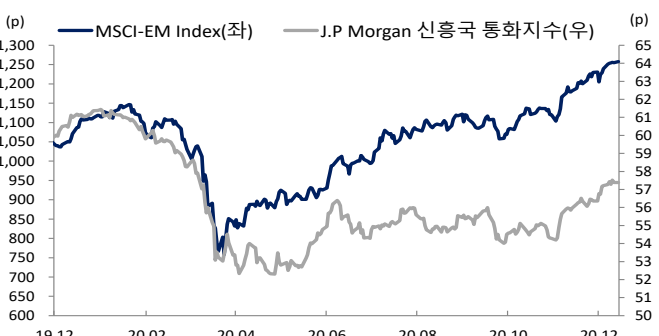
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



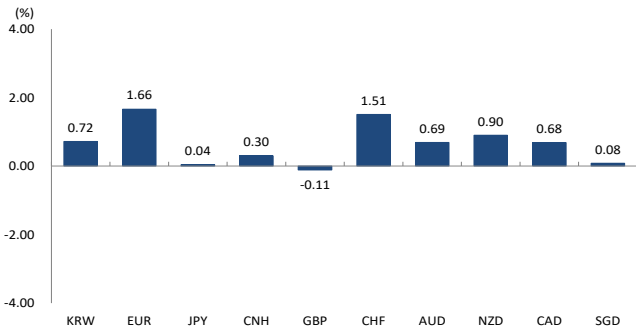
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



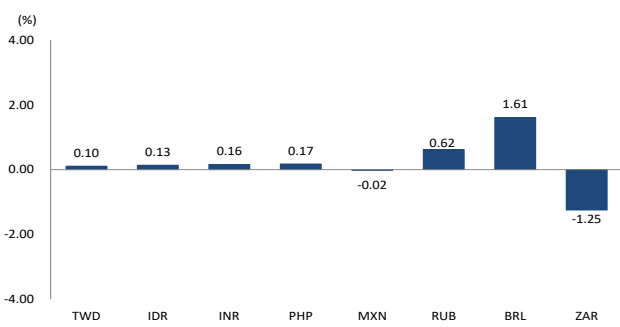
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

본 자료는 투자의 이해를 돕기 위해 참고가 되는 정보 제공을 목적으로 작성되었습니다. 당사 고객들에게 배포되는 자료로서 본 조사자료의 내용은 당사의 리서치센터에서 신뢰할 수 있는 자료와 정보를 이용하여 작성한 것이나, 당사는 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 투자자는 자신의 판단과 책임하에 투자를 하여야 하며, 본 자료는 투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙자료로 사용될 수 없습니다. 그리고 파생상품은 높은 가격변동성으로 인해 단기간에 투자원금의 전부 또는 상당부분을 손실할 수 있습니다. 본 자료는 당사 홈페이지(www.futures.co.kr)에서도 이용하실 수 있습니다.