

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

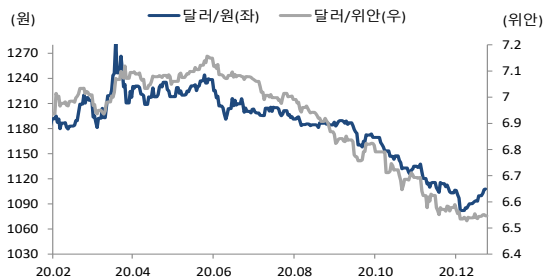
◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD102	1106.00	▲0.0	3.3	4,501
USD101	1105.30	▼1.2	3.6	847,800
USD/KRW	1107.90	▲0.5	3.2	
USD/CNY	6.5467	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

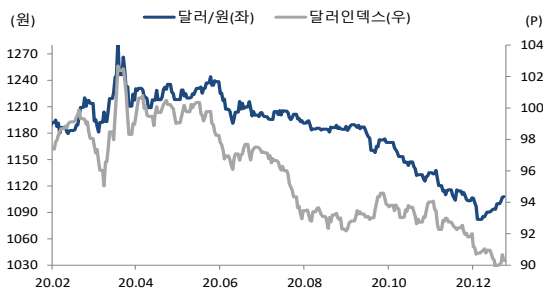
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	90.332	-0.322	UST2Y	0.1169
EUR/USD	1.2185	0.0022	UST10Y	0.9430
USD/JPY	103.54	-0.10	UST30Y	1.6837
GBP/USD	1.3494	0.0133	WTI	48.08

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

금 일(12/23)	익 일(12/24)	익 일(12/25)
22:30 미국 11월 내구재 수주 MoM(P) (결과: 0.9%, 이전 1.3%) 22:30 미국 11월 개인소비 MoM (결과: -0.4%, 이전 0.5%) 22:30 미국 11월 개인소득 MoM (결과: -1.1%, 이전 0.7%) 22:30 미국 주간 신규실업보험 청구 (결과 803K, 이전 885K) 00:00 미국 12월 미시간대 소비자신뢰(F) (결과 80.7, 이전 81.4)	N/A 일본 BOJ 총재 연설 N/A 독일, 미국, 프랑스, 캐나다, 호주 홍콩 조기 폐장	08:30 일본 11월 실업률(예상:3.1%, 이전:3.1%) 08:50 일본 11월 소매매출 YoY(예상:1.7%, 이전:11.9%)

브렉시트 타결 기대, 엇갈린 경기지표

금일 달러/원 예상 : 1,102.00~1,110.00

NDF 최종호가 : 1,105.30/1,105.70(-1.05)

야간달러선물 종가 : 1,105.30원 | 고가:--- | 저가:--- |

전일 국내 동향

영국 발 변종 코로나 확산에 대한 우려감에 전일 대비 1.6원 오른 1109원에 강한 환율은 1100원대 후반에서 좁은 폭 등락. 이후 영국 언론에서 브렉시트 협상 타결 가능성을 보도하며 달러 강세 제한되었고, 이와 연동해 환율도 상승세를 줄임. 증시가 상승 전환하고 외국인도 순매수 전환해 환율은 상승세를 되돌리며 전일 대비 0.5원 오른 1107.9원에 마감.

전일 해외 동향

달러화는 영국과 EU간 무역협상 타결 기대감에 파운드화와 유로화가 상승하며 하락.

파운드화는 영국과 EU가 10개월 넘게 끌어온 브렉시트 무역협상이 합의에 임박했으며, 양측은 합의문 문구를 조율하고 양측이 막판 타결을 위해 노력하고 있다고 알려지며 급등. 이에 파운드화는 달러당 1.356달러까지 고점을 높임.

한편 미국 경기지표는 엇갈린 양상을 나타냈는데, 미국 주간 실업수당 청구건수(80만2천명)는 3주만에 감소세로 전환. 예상치(88만 8천명)와 이전치(89만2천명)를 모두 하회했음. 다만 미국 11월 개인소득은 전월대비 1.1%하락했고, 11월 개인소비는 0.4%하락하며 각각 예상치(-0.3%)와(-0.2%)를 모두 밑돌았음. 브렉시트 타결 임박 소식이 트럼프 대통령은 의회가 승인한 부양책을 규모 확대를 요구하며 서명을 거부했다는 우려감을 희석하며 미국 주요 증시는 일제히 상승.

금일 전망

금일 환율은 미국 부양책 합의에 대한 기대감과 영국과 EU간 브렉시트 무역협상의 타결 기대로 인한 위험선호심리에 하락 우위를 전망.

오랜기간 끌어온 브렉시트 무역협상에 임박하며 나스닥을 제외한 미국의 주요 증시는 상승 마감. 이와 연동해 5거래일 만에 매수우위로 전환한 외국인의 매수세 금일도 이어질 가능성은 환율 하락 요인. 이에 더해 미국 의회에서 1조4천억달러 규모의 새해 예산과 9천억달러 규모 추가 부양책을 승인한 점과 관련해 펠로시 민주당 하원의원이 예산안에 대한 서명을 중용하고 있어 연말 연초 부양책에 대한 기대감은 우위에 있는 모습. 다만 대해 트럼프 대통령이 서명을 거부하는 노이즈가 가파른 달러 약세를 제한할 것. 이에 금일 환율은 브렉시트 합의 가능성과 글로벌 달러 약세 우위에 롱포지션은 제한될 것으로 보이며, 6.5위안까지 강세폭을 되돌린 위안과 증시 외국인 동향 주시하며 약보합권 등락을 전망.

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD102	1,106.00	0.00	1,107.60	1,108.90	1,105.60	3.30	2,034	537	4,501	1,305
USD101	1,105.30	-1.20	1,107.00	1,108.90	1,105.30	3.60	227,812	-70,021	847,800	10,001
USD SPOT	1,107.90	0.50	1,109.00	1,110.50	1,107.30	3.20	4,618	-848	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	47,760	46,364	1,396	-4,277	-6,779
은행	6,365	2,903	3,462	18,122	119,823
투신	2,271	4,676	-2,405	-34,928	-46,790
보험	220	276	-56	-787	-12,799
기타법인	5,916	5,381	535	-11,035	-20,704
개인	26,998	25,221	1,777	8,531	3,128
외국인	141,106	145,815	-4,709	24,604	-35,609

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,759.82	26.14
국고채3Y	0.932	-0.013
국고채10Y	1.640	-0.017

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	22.073	-0.085

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	829	-5,476	-39,918
KOSDAQ	1,814	2,082	7,974
국고채	1,350	13,406	17,328
통안채	300	8,927	18,506

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14800	0.00475
Call	0.650	0.170	3M	0.25100	0.01287
CD	0.660	0.000	6M	0.26375	0.00100
통안1년	0.716	-0.006	12M	0.33863	0.00138

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	30,129.83	114.32	0.38	-0.08
S&P	3,690.01	2.75	0.07	-0.30
나스닥	12,771.11	-36.81	-0.29	0.89
FTSE 100	6,495.75	42.59	0.66	-1.14
DAX 30	13,587.23	169.12	1.26	0.16
Nikkei 225	26,524.79	88.40	0.33	-0.87
Shanghai	3,382.32	25.54	0.76	0.46
항셍 H	10,482.52	98.34	0.95	0.20
미국채 2년	0.1169	0.0040	3.54	1.65
미국채 10년	0.9430	0.0266	2.90	2.91
WTI	48.08	1.06	2.25	0.54
Gold	1,873.18	5.44	0.29	0.98

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	-1.35	0.05
3M	-1.40	-0.20
6M	-1.40	-0.10
12M	-1.40	-0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.120	0.005
2Y	0.170	0.000
3Y	0.200	0.005
4Y	0.235	0.005
5Y	0.285	0.005

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화

*영업일 기준으로 집계

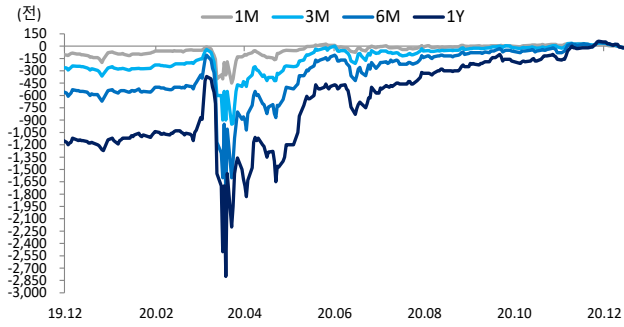
아시아 통화

기타 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	90.332	-0.322	-0.13	USD/KRW	1,107.60	0.10	1.25	USD/RUB	75.0930	-0.8098	2.38
EUR/USD	1.2185	0.0022	-0.12	USD/CNY	6.5406	-0.0023	0.12	USD/BRL	5.2053	0.0425	2.35
USD/JPY	103.54	-0.10	0.07	USD/HKD	7.7530	0.0003	0.01	USD/ZAR	14.6014	-0.0726	-1.46
GBP/USD	1.3494	0.0133	-0.11	USD/SGD	1.3305	-0.0054	0.10	USD/MXN	20.0676	-0.0695	1.03
USD/CHF	0.8884	-0.0012	0.34	USD/TWD	28.346	0.000	0.16	USD/PLN	3.6964	-0.0070	1.62
AUD/USD	0.7579	0.0056	0.03	USD/INR	73.76	-0.09	0.24	USD/TRY	7.6391	-0.0174	-2.06
NZD/USD	0.7101	0.0061	-0.15	USD/IDR	14,200	-5	0.53	USD/SEK	8.2947	-0.0481	-0.70
USD/CAD	1.2849	-0.0059	0.83	USD/THB	30.220	0.160	0.67	USD/NOK	8.6468	-0.0959	-0.29

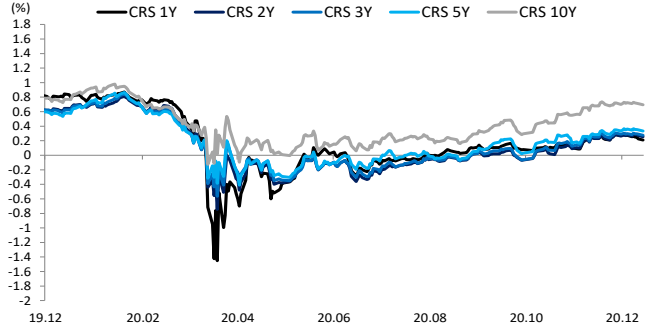
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



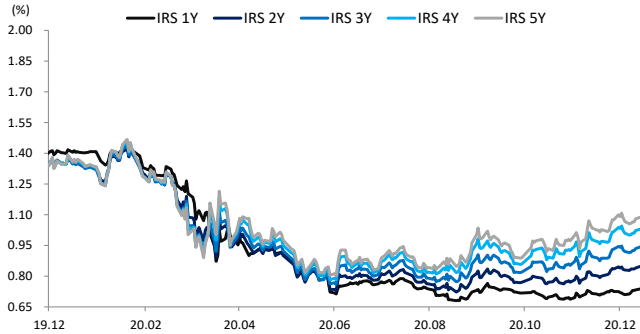
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



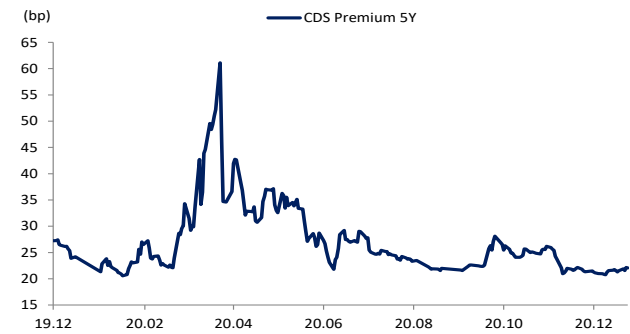
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



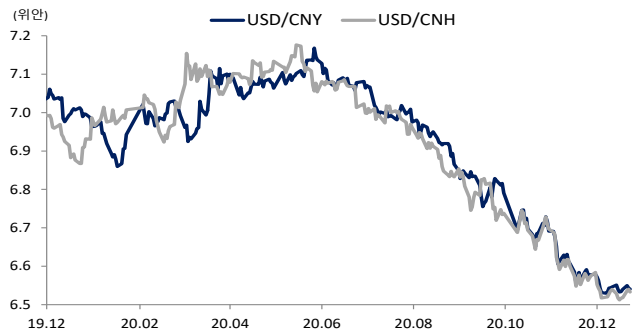
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



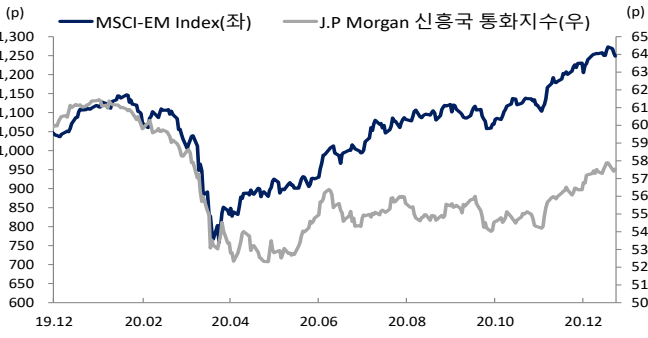
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



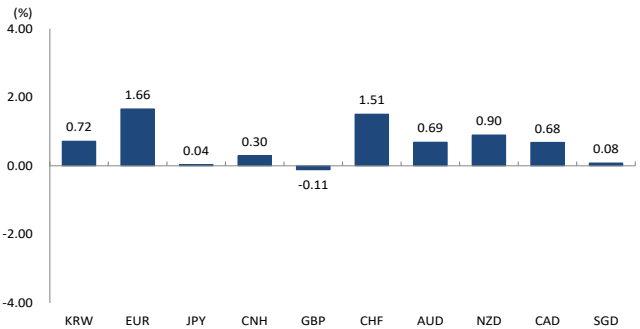
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



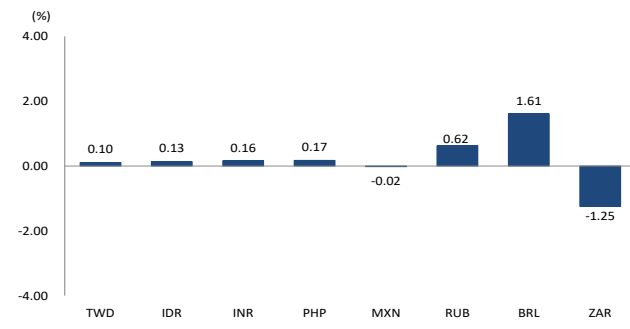
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

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.