

## FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

## ◇ 전일 국내시장 동향

| 종목      | 전일종가    | 전일비<br>(원) | 변동폭<br>(고가-저가) | 미결제약정<br>(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

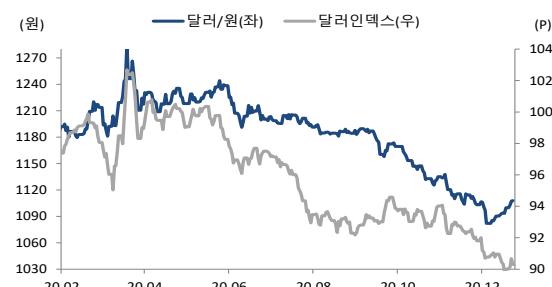
| 종목        | 전일종가   | 전일비(bp) | 종목     | 전일종가   |
|-----------|--------|---------|--------|--------|
| USD Index | 90.332 | -0.322  | UST2Y  | 0.1169 |
| EUR/USD   | 1.2185 | 0.0022  | UST10Y | 0.9430 |
| USD/JPY   | 103.54 | -0.10   | UST30Y | 1.6837 |
| GBP/USD   | 1.3494 | 0.0133  | WTI    | 48.08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

## 차트1. 달러/원 &amp; 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트2. 달러/원 &amp; 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 경제지표 및 이벤트

| 금 일(12/23)                                     | 의 일(12/24)                        | 의 일(12/25)                               |
|--|-----------------------------------|--|
| 22:30 미국 11월 내구재 수주 MoM(P) (결과: 0.9%, 이전 1.3%) | N/A 일본 BOJ 총재 연설                  | 08:30 일본 11월 실업률(예상:3.1%, 이전:3.1%)       |
| 22:30 미국 11월 개인소비 MoM (결과 -0.4%, 이전 0.5%)      | N/A 독일, 미국, 프랑스, 캐나다, 호주 홍콩 조기 폐장 | 08:50 일본 11월 소매매출 YoY(예상:1.7%, 이전:11.9%) |
| 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)  |                                   |  |

## USD Futures &amp; Spot

| 종목       | 종가       | 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

| 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

| 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

| 만기     | Mid    | 전일비    |
|--------|--------|--------|
| CDS 5Y | 22.073 | -0.085 |

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

| 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

| Korea | 종가    | 전일비    | US Libor | 종가      | 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         | 종가        | 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

| 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

| 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 |

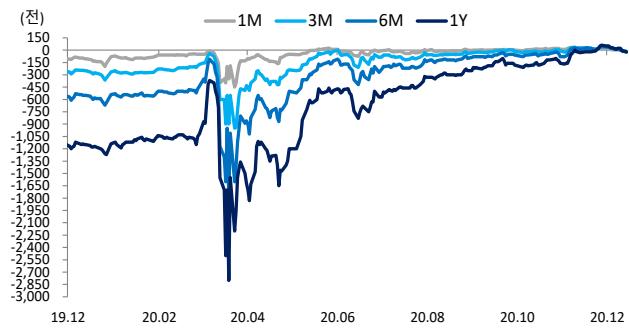
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

| 아시아 통화    |        |         |       |         | 기타 통화    |         |       |         |         |         |       |
|-----------|--------|---------|-------|---------|----------|---------|-------|---------|---------|---------|-------|
| 종목        | 종가     | 전일비     | 1주(%) | 종목      | 종가       | 전일비     | 1주(%) | 종목      | 종가      | 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 |

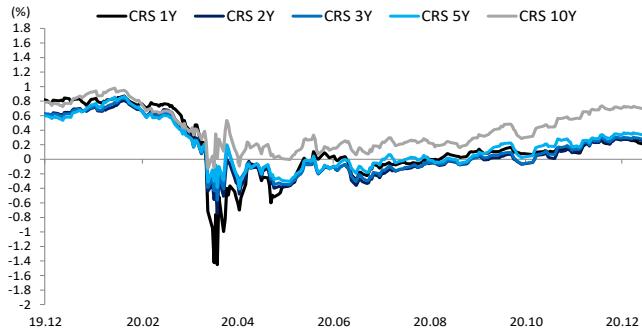
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



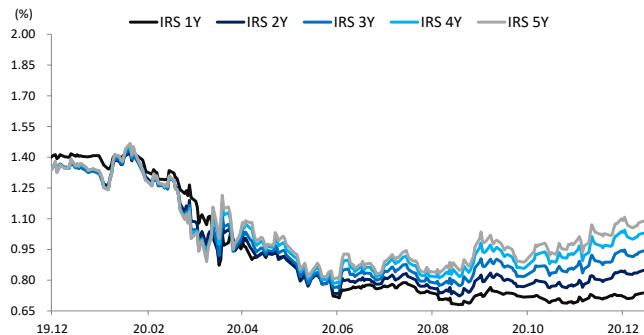
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



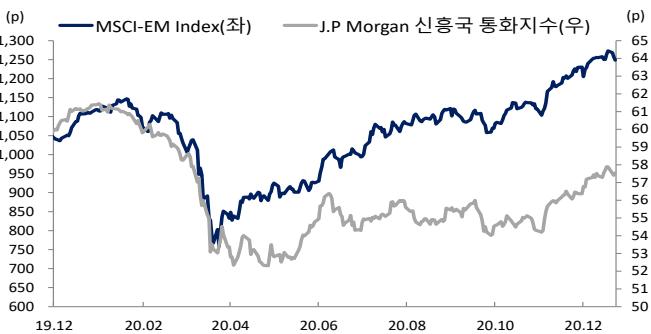
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



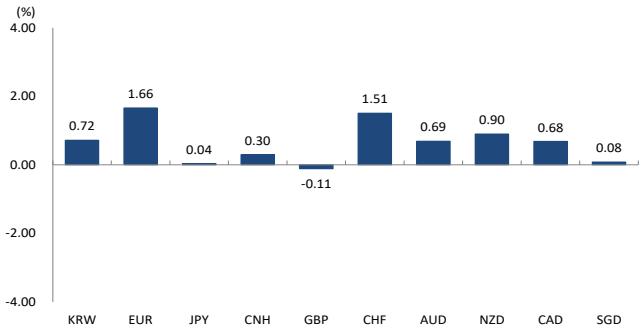
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



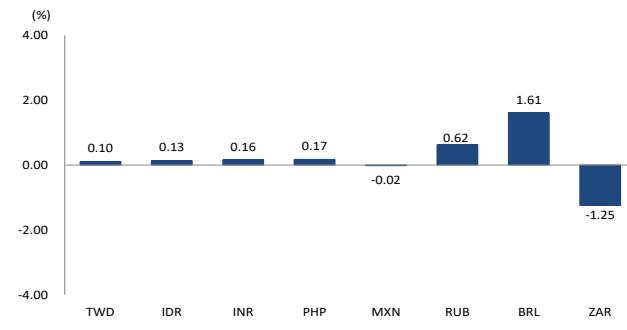
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터