

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

美부양책 & 브렉시트, 완화되는 불확실성

금일 달러/원 예상 : 1,092.00~1,100.00

NDF 최종호가 : 1,096.60/1,097.00(+1.40)

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD101	1094.80	▼5.0	9.5	859,547
USD102	1094.60	▼5.4	8.9	4,044
USD/KRW	1096.70	▼6.3	8.3	
USD/CNY	6.5293	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	90.282	-0.041	UST2Y	0.1189
EUR/USD	1.2216	0.0029	UST10Y	0.9231
USD/JPY	103.81	0.16	UST30Y	1.6589
GBP/USD	1.3452	-0.0106	WTI	47.70

전일 국내 동향

전일 대비 0.5원 내린 1102.5원에 개장. 오전 중 트럼프 대통령이 코로나 구제를 위한 법안에 서명하기로 결정하고 미국 백악관이 이를 승인하며, 미국 주요지수 선물은 반등. 이에 금융시장에 위험선호심리가 우위를 보이며 아시아 증시는 중국을 제외하고 대체적으로 상승했고, 달러화는 낙폭을 키움. 외국인인 우리증시에서 529억 가량 순매수하며 3거래일 연속 매수 우위를 이어가 환율 하락에 힘을 보탬. 이에 환율은 트럼프 서명 소식 이후부터 장중 꾸준히 하락해 1095원까지 저점을 낮춤. 다만 장중 중국 당국이 마윈의 앤트그룹에 사실상 해체 명령을 내렸다는 소식이 전해지며 중국 증시 약세와 연동해 위안화는 강세를 되돌렸음. 이에 환율은 하락세 제한되며 전일 대비 6.25원 내린 1096.65원에 마감.

전일 해외 동향

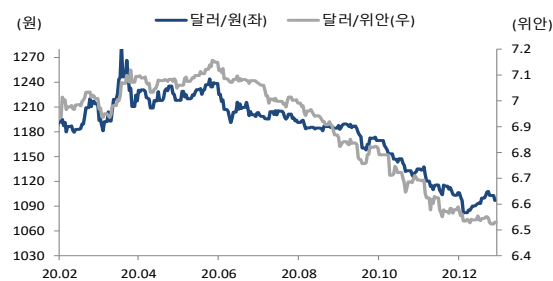
달러화는 트럼프 대통령이 2.3조 달러의 코로나 구제책과 예산안에 서명에 따른 위험선호심리와 영국과 EU간 무역협정의 체결에 따른 유로화 강세에 하락압력 있었으나 안전자산인 엔화 약세에 강보합.

달러화는 연말 적어진 거래량 속에 트럼프 무역협정의 서명 소식에도 좁은 폭 등락하는 흐름을 이어갔음. 미국 트럼프 대통령이 서명한 경기부양책과 2021 회계연도 예산안 규모는 각각 9천억 달러, 1조 4천억 달러. 트럼프 서명으로 금융시장이 우려해왔던 연방정부의 섀다운 가능성이 해소되었고, 추가 실업급여 지원과 강제 퇴거 유예등이 진행될 것으로 보임. 이에 뉴욕 주요 지수는 랠리를 이어갔고, 엔화는 전일 대비 0.3%오른 103.88엔까지 고점을 높여 약세 마감. 파운드화는 EU와 영국의 무역협정 소식에 3거래일 연속 랠리를 이어가며 지난 5월 이래 최고점일 파운드당 1.36달러까지 고점을 높였으나, 무역협정의 세부내용이 영국 경제에 불리하게 작용할 수 있다는 우려감으로 간밤 1%가까이 급락해 무역협상 이전 수준으로 후퇴.

금일 전망

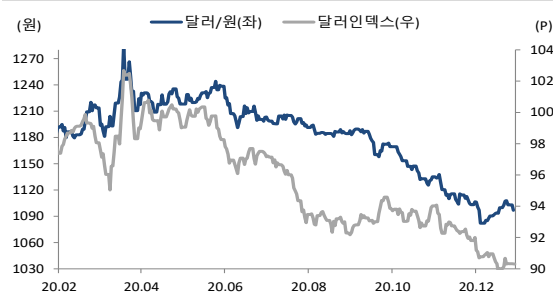
금일 환율은 연말 적어진 거래량 속에 소극적인 포지션 플레이가 이어질 것으로 보이며, 금융시장 위험선호심리 우위에 따른 외국인 증시 순매수 가능성에 약보합 전망. 다만 간밤 엔화가 약세폭을 키우며 달러화를 지지했고, 최근 중국 당국이 알리바바 그룹에 반독점에 대한 규제를 가하며 위안화는 최근의 낙폭을 되돌리고 있음. 한편 프랑스와 독일, 이탈리아, 스페인 등 유럽연합 회원국을 대상으로 백신 접종이 시작됐다는 소식은 유로화를 지지하며 롱포지션도 제한될 것으로 보임. 이에 금일 외국인 증시와 달러화 향방 주시하며 보험권 등락을 예상.

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(12/28)	금 일(12/29)	익 일(12/30)
00:30 미국 12월 달러스 연준 제조업활동(결과:9.7, 이전:12.0)	06:00 한국 12월 소비자심리지수(예상:-, 이전:97.9)	08:00 한국 11월 산업생산 YoY(예상:-0.5%, 이전:-2.2%)
		23:45 미국 12월 MNI 시카고 PMI(예상:56.5, 이전:58.2)
		00:00 미국 11월 도매재고 MoM(예상:0.7%, 이전:1.1%)
	(12/30)	(12/31)
	00:00 미국 12월 CB소비자심리지수(예상:97.0, 이전:96.1)	00:00 미국 11월 미결제주매매 MoM(예상:0.1%, 이전:-1.1%)

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD101	1,094.80	-5.00	1,101.50	1,101.50	1,092.00	9.50	223,179	-10,693	859,547	19,831
USD102	1,094.60	-5.40	1,100.10	1,101.00	1,092.10	8.90	1,370	125	4,044	296
USD SPOT	1,096.70	-6.30	1,102.50	1,103.30	1,095.00	8.30	0	-3,861	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	34,396	31,707	2,689	10,010	-20,897
은행	3,282	1,020	2,262	34,750	115,259
투신	1,029	3,010	-1,981	-31,209	-47,150
보험	74	421	-347	-653	-11,885
기타법인	5,930	12,010	-6,080	-7,100	-28,425
개인	34,349	29,512	4,837	8,186	-1,879
외국인	146,180	147,360	-1,180	-13,954	-5,153

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, %, %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,808.60	1.74
국고채3Y	0.958	0.008
국고채10Y	1.681	-0.001

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	529	748	-41,521
KOSDAQ	2,743	6,651	9,943
국고채	870	5,507	17,635
통안채	902	12,327	22,227

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : %, %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14513	-0.00287
Call	0.000	-0.650	3M	0.24013	-0.01087
CD	0.660	0.000	6M	0.26663	0.00288
통안1년	0.736	0.004	12M	0.34038	0.00175

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	30,403.97	204.10	0.68	0.75
S&P	3,735.36	32.30	0.87	0.70
나스닥	12,899.42	94.69	0.74	1.13
FTSE 100	6,502.11	6.36	0.10	-0.75
DAX 30	13,790.29	203.06	1.49	0.90
Nikkei 225	26,854.03	197.42	0.74	0.52
Shanghai	3,397.29	0.72	0.02	-0.68
항셱 H	10,311.48	-119.05	-1.14	-1.64
미국채 2년	0.1189	0.0000	0.00	-1.74
미국채 10년	0.9231	0.0000	0.00	-1.23
WTI	47.70	-0.53	-1.10	-2.85
Gold	1,876.63	-6.83	-0.36	-0.08

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	-1.40	0.40
3M	-1.20	0.50
6M	-1.30	0.10
12M	-1.30	0.30

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : %, %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.125	0.020
2Y	0.175	0.020
3Y	0.205	0.020
4Y	0.240	0.020
5Y	0.290	0.020

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화

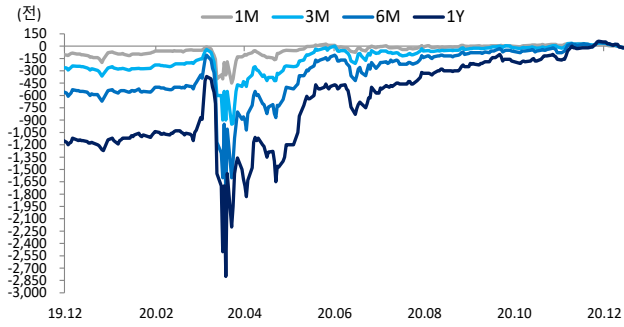
*영업일 기준으로 집계

아시아 통화

종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	90.282	-0.041	-0.41	USD/KRW	1,096.65	-6.25	-0.98	USD/RUB	73.7663	-0.1218	-2.81
EUR/USD	1.2216	0.0029	0.44	USD/CNY	6.5371	0.0071	-0.09	USD/BRL	5.2473	0.0734	1.64
USD/JPY	103.81	0.16	0.16	USD/HKD	7.7559	0.0021	0.04	USD/ZAR	14.6426	0.0314	-0.21
GBP/USD	1.3452	-0.0106	0.68	USD/SGD	1.3298	0.0009	-0.46	USD/MXN	20.0152	0.1481	-0.61
USD/CHF	0.8893	-0.0018	-0.03	USD/TWD	28.317	-0.007	-0.10	USD/PLN	3.6818	-0.0150	-0.58
AUD/USD	0.7579	-0.0018	0.74	USD/INR	73.50	-0.04	-0.47	USD/TRY	7.4383	-0.1476	-2.85
NZD/USD	0.7100	-0.0004	0.85	USD/IDR	14,155	-45	-0.35	USD/SEK	8.2759	0.0168	-0.80
USD/CAD	1.2854	-0.0009	-0.42	USD/THB	30.165	-0.055	-0.13	USD/NOK	8.6362	-0.0259	-1.22

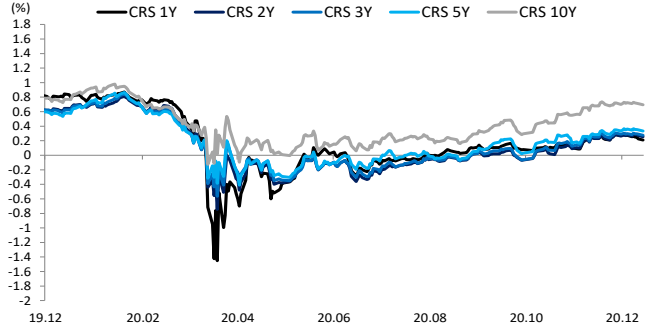
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



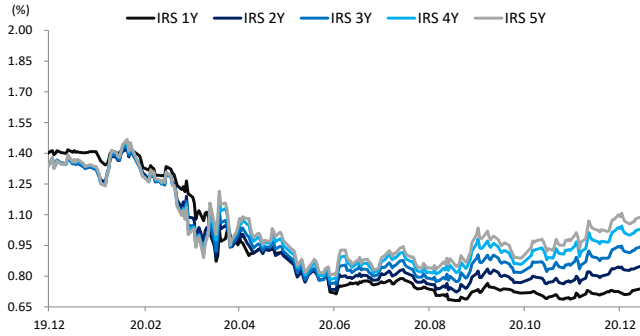
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



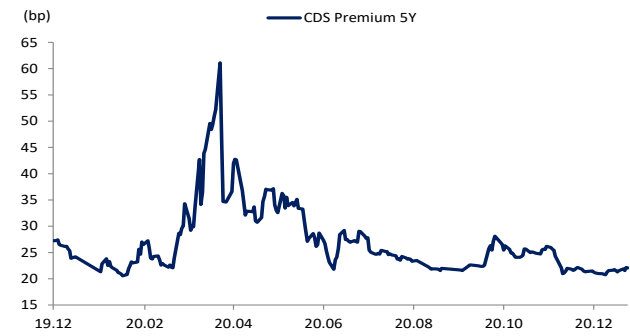
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



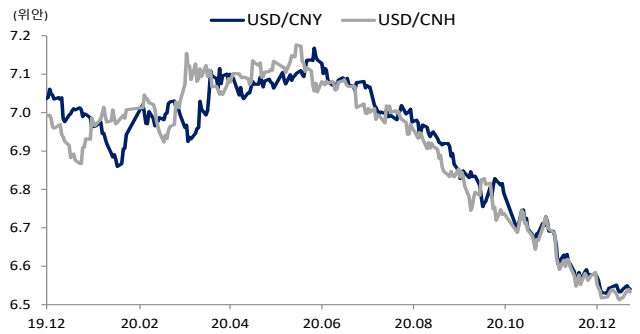
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



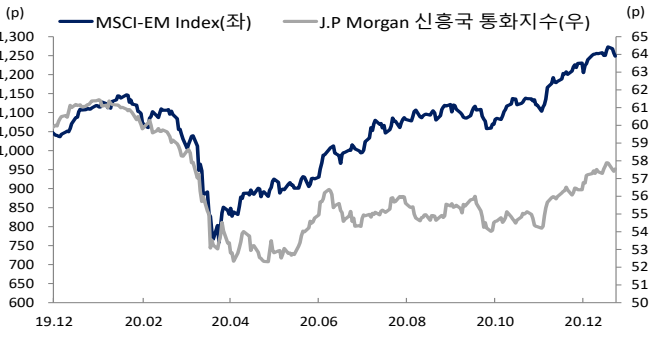
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



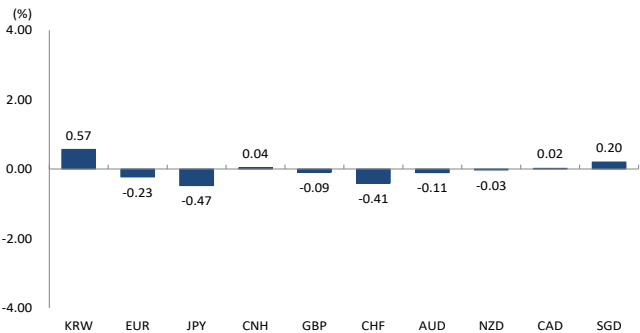
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



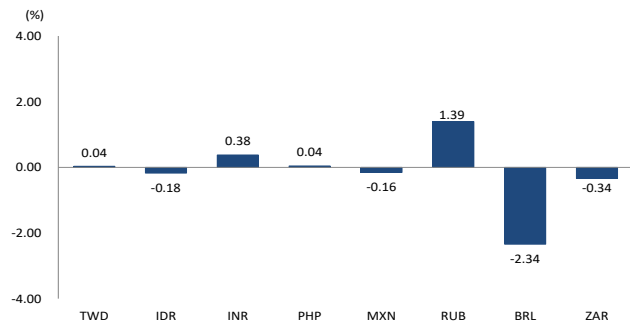
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

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.