

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

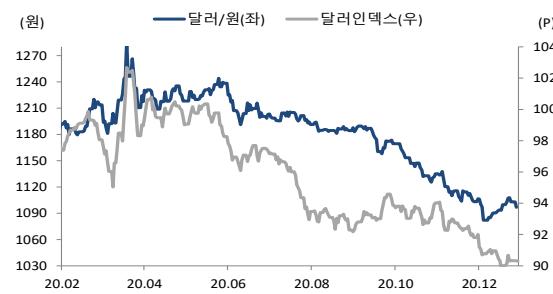
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	90.282	-0.041	UST2Y	0.1189
EUR/USD	1.2216	0.0029	UST10Y	0.9231
USD/JPY	103.81	0.16	UST30Y	1.6589
GBP/USD	1.3452	-0.0106	WTI	47.70

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)

00:30 미국 12월 딜러스 연준 제조업활동(결과:9.7, 이전:12.0)

금 일(12/29)

06:00 한국 12월 소비자심리지수(예상:--, 이전:97.9)

의 일(12/30)

08:00 한국 11월 산업생산 YoY(예상:-0.5%, 이전:-2.2%)

(12/30)

00:00 미국 12월 CB소비자신뢰지수(예상:97.0, 이전:96.1)

(12/31)

00:00 미국 11월 미결주택매매 MoM(예상:0.1%, 이전:-1.1%)

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 중시는 중국을 제외하고 대체적으로 상승했고, 달러화는 낙폭을 키움. 외국인은 우리증시에서 529억 가량 순매수하며 3거래일 연속 매수 우위를 이어가 환율 하락에 힘을 보탰. 이에 환율은 트럼프 서명 소식 이후부터 장중 꾸준히 하락해 1095원 까지 저점을 낮춤. 다만 장중 중국 당국이 마윈의 앤트그룹에 사실상 해체 명령을 내렸다는 소식이 전해지며 중국 중시 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 무역합의 체결에 따른 유로화 강세에 하락압력 있었으나 안전자산인 엔화 약세에 강보합.

달러화는 연말 적어진 거래량 속에 트럼프 무역합의 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 셧다운 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, 무역합의 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 중시 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 중시와 달러화 향방 주시하며 보합권 등락을 예상.

USD Futures & Spot

종목	종가	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

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

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

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

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	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	종가	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
항셍 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

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

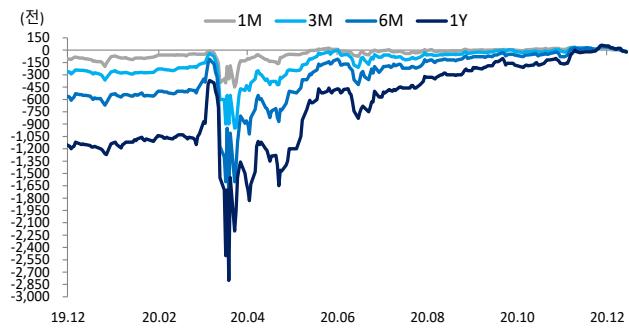
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

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

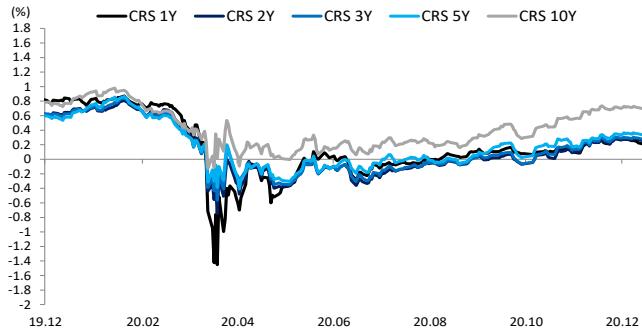
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



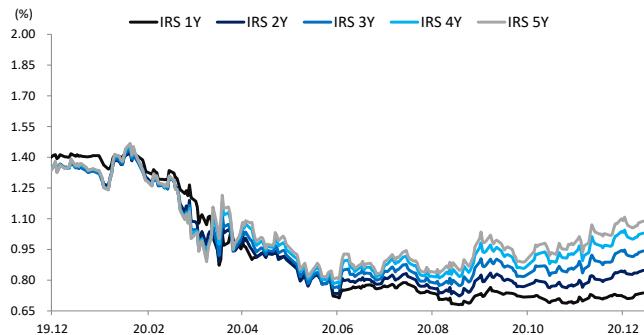
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



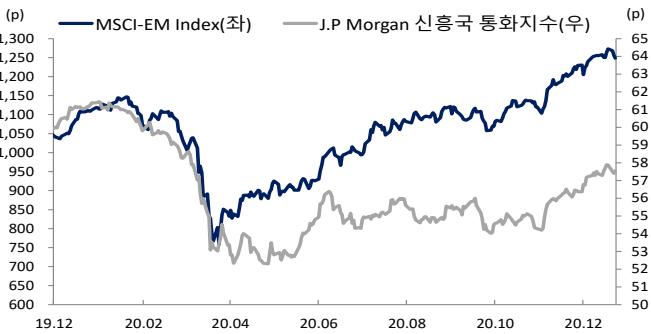
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



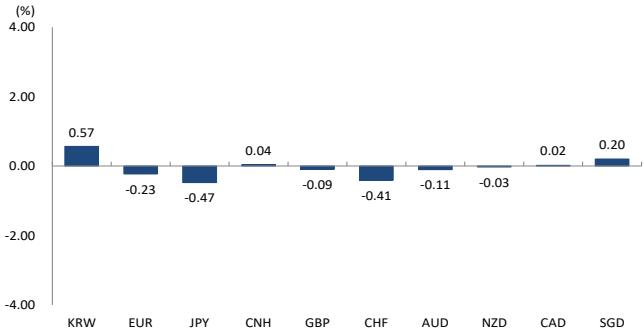
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



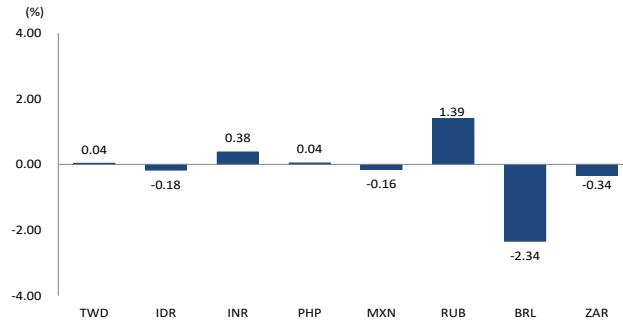
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터