

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

연말 네고 물량 vs 외국인 역송금

금일 달러/원 예상 : 1,088.00~1,095.00

NDF 최종호가 : 1,091.60/1,092.00(+0.05)

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD101	1091.40	▼3.4	6.2	867,888
USD102	1091.40	▼3.2	5.7	4,909
USD/KRW	1092.10	▼4.6	6.8	
USD/CNY	6.5311	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

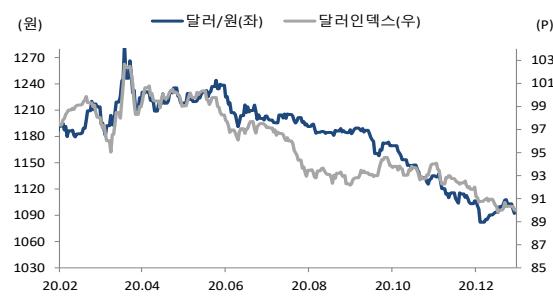
종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	89.995	-0.342	UST2Y	0.1250
EUR/USD	1.2249	0.0033	UST10Y	0.9364
USD/JPY	103.58	-0.23	UST30Y	1.6750
GBP/USD	1.3503	0.0051	WTI	48.09

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(12/29)

23:00 미국 12월 주택가격지수 MoM(결과: 1.6%, 이전: 1.4%)

금 일(12/30)

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

의 일(12/31)

08:00 한국 12월 CPI YoY(예상:0.5%, 이전:0.6%)

23:45 미국 12월 MNI 시카고 PMI(예상:56.5, 이전:58.2)

10:00 중국 12월 제조업 PMI(예상:52.0, 이전:52.1)

00:00 미국 11월 도매재고 MoM(예상:0.7%, 이전:1.1%)

10:00 중국 12월 비제조업 PMI(예상:56.4, 이전:56.4)

(12/31)

22:30 미국 주간 신규실업수당 청구건수(예상:833K, 이전:803K)

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

한국, 일본, 독일, 이탈리아 휴장

영국 호주 조기종료

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD101	1,091.40	-3.40	1,095.50	1,096.50	1,090.30	6.20	185,149	-38,420	867,888	8,341
USD102	1,091.40	-3.20	1,095.40	1,096.20	1,090.50	5.70	1,347	-23	4,909	865
USD SPOT	1,092.10	-4.60	1,097.50	1,098.00	1,091.20	6.80	3,733	820	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	26,092	42,540	-16,448	-24,210	-10,228
은행	3,352	1,779	1,573	32,517	116,574
투신	1,529	2,939	-1,410	-17,588	-45,039
보험	39	626	-587	-983	-8,495
기타법인	7,997	3,640	4,357	150	-21,716
개인	24,364	23,087	1,277	7,752	5,011
외국인	123,302	112,089	11,213	2,367	-35,962

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,820.51	11.91
국고채3Y	0.973	0.015
국고채10Y	1.698	0.017

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	22.051	0.051

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-3,106	-2,001	-20,099
KOSDAQ	1,116	7,022	11,685
국고채	71	5,240	16,686
통안채	0	4,622	21,227

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14675	0.00162
Call	0.500	0.020	3M	0.25388	0.01375
CD	0.660	0.000	6M	0.25713	-0.00950
통안1년	0.744	0.008	12M	0.34125	0.00087

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	30,335.67	-68.30	-0.22	0.39
S&P	3,727.04	-8.32	-0.22	0.87
나스닥	12,850.22	-49.20	-0.38	0.85
FTSE 100	6,602.65	100.54	1.55	1.13
DAX 30	13,761.38	-28.91	-0.21	0.96
Nikkei 225	27,568.15	714.12	2.66	4.28
Shanghai	3,379.04	-18.25	-0.54	0.66
항셍 H	10,449.17	137.69	1.34	0.46
미국채 2년	0.1250	0.0061	5.13	10.72
미국채 10년	0.9364	0.0133	1.44	2.18
WTI	48.09	0.47	0.99	0.73
Gold	1,879.17	2.54	0.14	0.61

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	-0.40	1.00
3M	-0.45	0.75
6M	-0.40	0.90
12M	-0.30	1.00

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.240	0.115
2Y	0.295	0.120
3Y	0.320	0.115
4Y	0.350	0.110
5Y	0.400	0.110

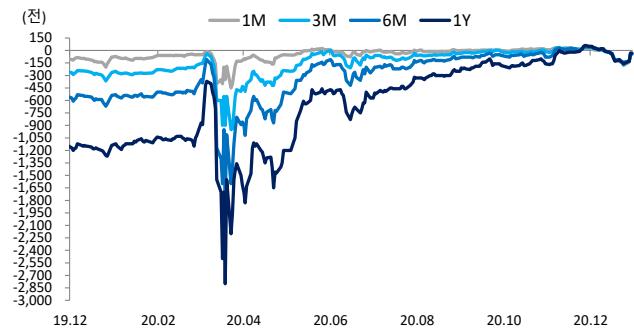
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	89.995	-0.342	-0.73	USD/KRW	1,092.15	-4.50	-1.39	USD/RUB	74.0424	0.2761	-2.45
EUR/USD	1.2249	0.0033	0.71	USD/CNY	6.5308	-0.0063	-0.18	USD/BRL	5.2039	-0.0434	0.80
USD/JPY	103.58	-0.23	-0.06	USD/HKD	7.7540	-0.0019	0.02	USD/ZAR	14.7181	0.0755	0.30
GBP/USD	1.3503	0.0051	1.06	USD/SGD	1.3273	-0.0025	-0.64	USD/MXN	19.9107	-0.1045	-1.12
USD/CHF	0.8842	-0.0051	-0.61	USD/TWD	28.510	0.193	0.58	USD/PLN	3.7038	0.0220	0.01
AUD/USD	0.7606	0.0027	1.10	USD/INR	73.44	-0.07	-0.56	USD/TRY	7.3869	-0.0514	-3.52
NZD/USD	0.7150	0.0050	1.56	USD/IDR	14,130	-25	-0.53	USD/SEK	8.2044	-0.0715	-1.66
USD/CAD	1.2818	-0.0036	-0.70	USD/THB	30.037	-0.128	-0.56	USD/NOK	8.6199	-0.0163	-1.40

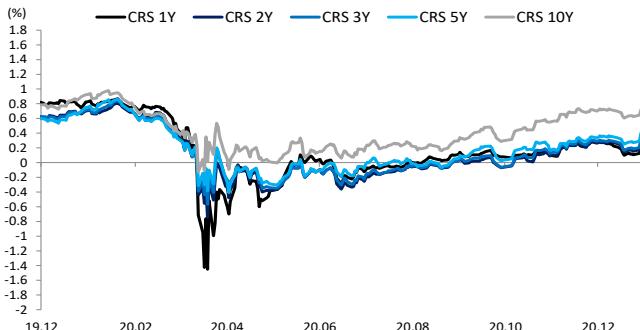
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



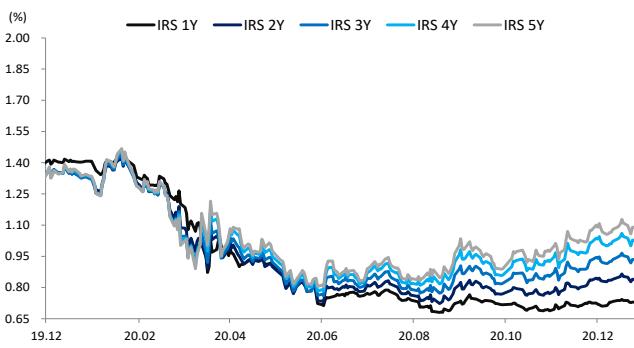
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



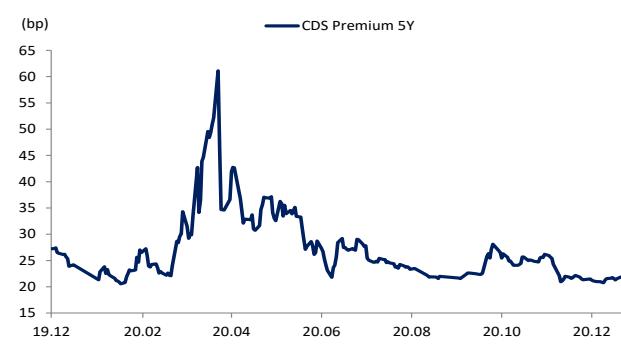
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



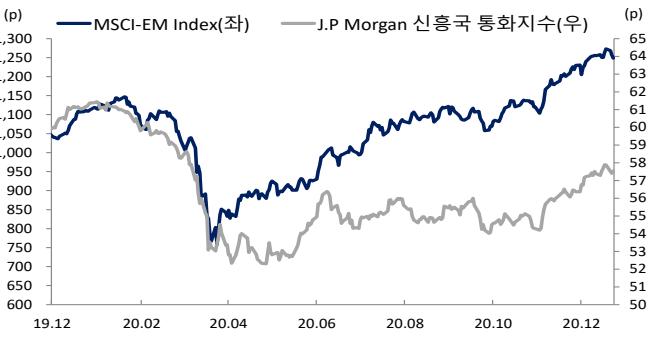
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



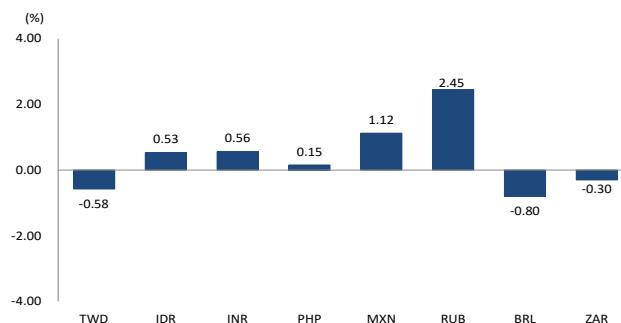
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터