

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

원화 강세, 약달러에 따라가기 버겁다

금일 달러/원 예상 : 1,078.00~1,086.00

NDF 최종호가 : 1,086.00/1,086.50(+4.50)

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD101	1081.00	▼4.5	6.9	848,357
USD102	1081.40	▼4.2	6.7	12,465
USD/KRW	1082.10	▼4.2	7.2	
USD/CNY	6.4664	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	89.878	0.198	UST2Y	0.1132
EUR/USD	1.2248	-0.0050	UST10Y	0.9132
USD/JPY	103.13	-0.06	UST30Y	1.6556
GBP/USD	1.3571	-0.0054	WTI	47.35

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(01/04)

17:50 독일 12월 마켓 제조업 PMI(결과:58.6, 이전:58.6)

18:00 유럽 12월 마켓 제조업 PMI(결과:55.2, 이전:55.5)

23:45 미국 12월 마켓 ISM 제조업 PMI(결과:57.1, 이전:56.5)

금 일(01/05)

16:45 프랑스 12월 CPI YoY(예상:0.2%, 이전:0.2%)

의 일(01/06)

10:45 중국 12월 차이신 제조업 PMI(예상:--, 이전:57.5)

10:45 중국 12월 차이신 서비스업 PMI(예상:58.0, 이전:57.8)

17:55 독일 12월 마켓 서비스업 PMI(예상:47.7, 이전:47.7)

18:00 유럽 12월 서비스업 PMI(예상:47.3, 이전:47.3)

23:45 미국 12월 서비스업 PMI(예상:55.3, 이전:55.3)

00:00 미국 11월 내구재주문(예상:0.9%, 이전:0.9%)

(01/06)

00:00 미국 12월 ISM 제조업지수(예상:56.5, 이전:57.5)

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD101	1,081.00	-4.50	1,086.90	1,086.90	1,080.00	6.90	285,950	20,762	848,357	-3,136
USD102	1,081.40	-4.20	1,086.50	1,086.70	1,080.00	6.70	2,843	1,433	12,465	925
USD SPOT	1,082.10	-4.20	1,087.50	1,087.50	1,080.30	7.20	6,333	1,428	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	(단위 : 계약)	
				5일누적	20일누적
금융투자	51,662	67,383	-15,721	-40,726	-51,954
은행	3,657	842	2,815	8,848	119,165
투신	6,575	2,652	3,923	9,515	-29,099
보험	129	1,067	-938	-5,225	-11,863
기타법인	11,378	9,463	1,915	6,678	-16,739
개인	37,748	35,604	2,144	4,909	-3,173
외국인	179,476	173,714	5,762	15,871	-5,997

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비	(단위 : pt, %, %p)
KOSPI	2,944.45	70.98	
국고채3Y	0.954	-0.022	
국고채10Y	1.723	0.010	

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비	(단위 : bp)
CDS 5Y	21.993	0.065	

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적	(단위 : 억원)
KOSPI	897	2,222	-22,654	
KOSDAQ	-803	5,619	9,792	
국고채	-1,695	7,089	15,463	
통안채	-814	3,309	18,676	

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비	(단위 : %, %p)
기준	0.500	0.000	1M	0.13975	-0.00413	
Call	0.670	0.000	3M	0.23725	-0.00113	
CD	0.660	0.000	6M	0.25588	-0.00175	
통안1년	0.727	-0.020	12M	0.34063	-0.00125	

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	30,223.89	-382.59	-1.25	0.08
S&P	3,700.65	-55.42	-1.48	-0.07
나스닥	12,698.45	-189.83	-1.47	-0.83
FTSE 100	6,571.88	111.36	1.72	1.17
DAX 30	13,726.74	7.96	0.06	2.30
Nikkei 225	27,258.38	-185.79	-0.68	2.21
Shanghai	3,502.96	29.89	0.86	3.13
항셍 H	10,722.99	-15.41	-0.14	2.80
미국채 2년	0.1132	-0.0079	-6.52	-4.79
미국채 10년	0.9132	0.0000	0.00	-1.07
WTI	47.35	-1.17	-2.41	-1.82
Gold	1,937.17	38.50	2.03	3.23

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비	(단위 : 원)
1M		-0.40	0.00
3M		-0.30	0.00
6M		-0.20	-0.20
12M		0.00	-0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비	(단위 : %, %p)
1Y	0.205	-0.035	
2Y	0.260	-0.035	
3Y	0.280	-0.030	
4Y	0.320	-0.030	
5Y	0.370	-0.030	

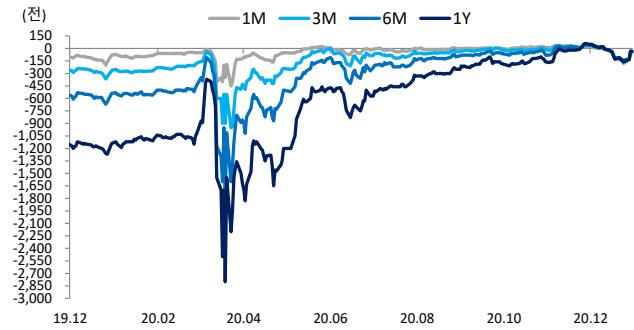
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화		기타 통화					
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	89.878	0.198	-0.51	USD/KRW	1,081.90	-4.45	-1.35
EUR/USD	1.2248	-0.0050	0.26	USD/CNY	6.4615	-0.0617	-1.16
USD/JPY	103.13	-0.06	-0.66	USD/HKD	7.7536	0.0010	-0.03
GBP/USD	1.3571	-0.0054	0.88	USD/SGD	1.3206	-0.0028	-0.69
USD/CHF	0.8815	0.0002	-0.88	USD/TWD	28.252	-0.051	-0.23
AUD/USD	0.7665	-0.0021	1.13	USD/INR	73.02	-0.28	-0.66
NZD/USD	0.7176	-0.0027	1.07	USD/IDR	13,895	-155	-1.84
USD/CAD	1.2778	0.0020	-0.59	USD/THB	29.888	-0.062	-0.92
USD/RUB	74.3254			USD/BRL	5.2715		
USD/ZAR	14.7258			USD/MXN	19.9739		
USD/PLN	3.7194			USD/TRY	7.4261		
USD/SEK	8.2545			USD/NOK	8.5556		

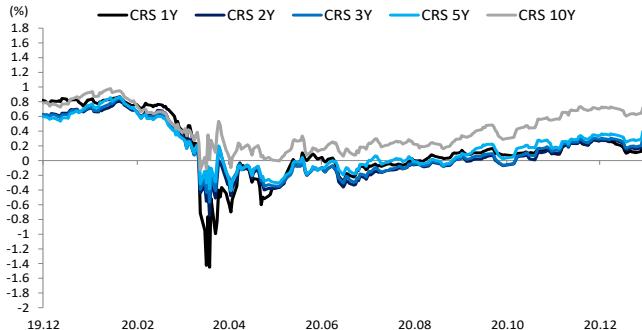
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



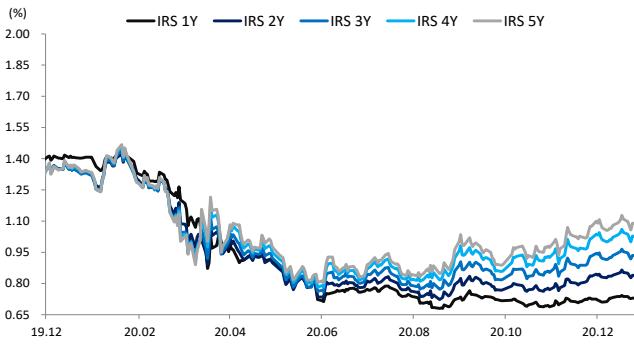
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



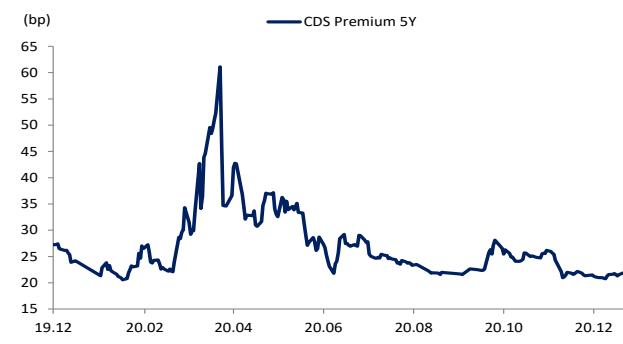
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



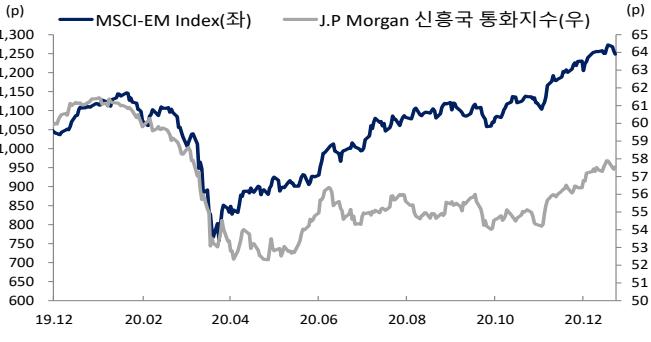
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



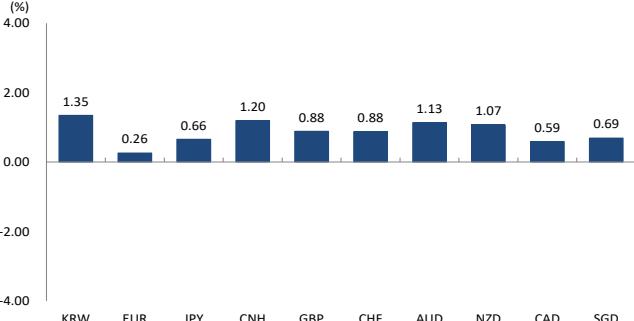
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



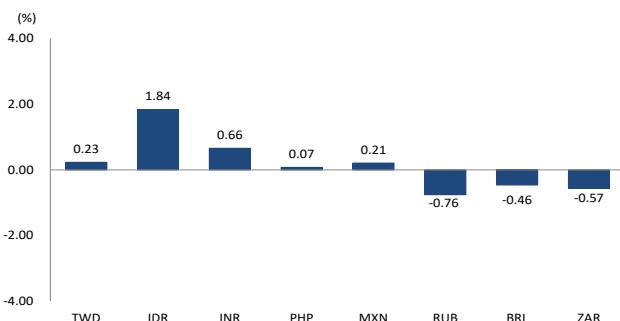
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터