

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

미국채 금리 급등하며 달러화 강세

금일 달러/원 예상 : 1,093.00~1,104.00

NDF 최종호가 : 1,097.30/1,097.90(+0.40)

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD101	1097.50	▲7.2	7.9	839,742
USD102	1096.70	▲7.3	8.1	56,422
USD/KRW	1097.30	▲7.5	7.5	
USD/CNY	6.4790	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	90.539	0.441	UST2Y	0.1449
EUR/USD	1.2151	-0.0067	UST10Y	1.1460
USD/JPY	104.26	0.32	UST30Y	1.8832
GBP/USD	1.3518	-0.0050	WTI	52.18

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(01/11)

18:30 유럽 1월 센티스 투자자기대지수(결과:1.3, 이전:-2.7)

금 일(01/12)

08:00 미국 로버트 카플란 달러스 연은 총재 연설

의 일(01/13)

15:00 일본 12월 공작기계수주 YoY(예상:-, 이전:8.6%)

02:00 미국 라파엘 보스틱 애틀란타 연은 총재 연설

08:50 일본 11월 경상수지(예상:1.551T, 이전:2.145T)

19:00 유럽 11월 산업생산 MoM(예상:0.2%, 이전:2.1%)

20:00 미국 NFIB 소기업낙관지수(예상:--, 이전:101.4)

22:30 미국 12월 CPI YoY(예상:1.3%, 이전:1.2%)

23:35 미국 라엘 브레이너드 연준 이사 연설

(01/12)

04:00 미국 애리조나 보스턴 연은 총재 연설

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD101	1,097.50	7.20	1,093.30	1,100.70	1,092.80	7.90	478,531	66,757	839,742	-26,888
USD102	1,096.70	7.30	1,092.50	1,100.60	1,092.50	8.10	21,183	16,339	56,422	39,745
USD SPOT	1,097.30	7.50	1,093.50	1,101.00	1,093.50	7.50	11,299	2,440	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	168,515	160,544	7,971	15,779	-33,154
은행	2,408	4,033	-1,625	7,856	77,262
투신	2,451	2,562	-111	-20,206	-45,877
보험	931	1,783	-852	-6,047	-12,390
기타법인	10,370	12,292	-1,922	-10,352	-24,810
개인	40,556	43,210	-2,654	3,045	-2,109
외국인	299,222	299,719	-497	10,175	41,568

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	3,148.45	-3.73
국고채3Y	0.980	0.002
국고채10Y	1.705	-0.024

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	24.187	0.109

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-7,119	4,393	-20,516
KOSDAQ	336	-1,985	6,951
국고채	-1,432	-1,473	26,851
통안채	2,796	8,900	23,946

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.12600	-0.00038
Call	0.460	-0.020	3M	0.22450	0.00012
CD	0.660	0.000	6M	0.25025	0.00375
통안1년	0.684	-0.006	12M	0.32688	-0.00275

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	31,008.69	-89.28	-0.29	2.60
S&P	3,799.61	-25.07	-0.66	2.67
나스닥	13,036.43	-165.55	-1.25	2.66
FTSE 100	6,798.48	-74.78	-1.09	3.45
DAX 30	13,936.66	-112.87	-0.80	1.53
Nikkei 225	28,139.03	648.90	2.36	2.53
Shanghai	3,531.50	-38.61	-1.08	0.81
항셍 H	11,059.51	103.96	0.95	3.14
미국채 2년	0.1449	0.0120	9.03	28.00
미국채 10년	1.1460	0.0307	2.75	25.49
WTI	52.18	-0.06	-0.11	9.58
Gold	1,848.72	-0.29	-0.02	-4.57

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	-0.10	0.15
3M	-0.30	0.10
6M	-0.30	0.20
12M	-0.30	0.20

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.185	-0.010
2Y	0.220	0.010
3Y	0.260	0.015
4Y	0.290	0.025
5Y	0.340	0.030

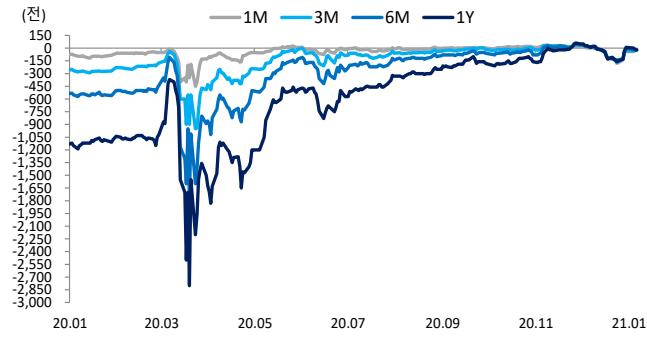
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	90.539	0.441	0.75	USD/KRW	1,097.20	7.50	1.41	USD/RUB	74.6668	#N/A	0.46
EUR/USD	1.2151	-0.0067	-0.79	USD/CNY	6.4814	0.0068	0.31	USD/BRL	5.5077	0.0865	4.48
USD/JPY	104.26	0.32	1.10	USD/HKD	7.7555	-0.0007	0.02	USD/ZAR	15.5302	0.2322	5.46
GBP/USD	1.3518	-0.0050	-0.39	USD/SGD	1.3309	0.0054	0.78	USD/MXN	20.0673	0.0522	0.47
USD/CHF	0.8903	0.0048	1.00	USD/TWD	28.239	0.019	-0.05	USD/PLN	3.7274	0.0336	0.22
AUD/USD	0.7697	-0.0060	0.42	USD/INR	73.39	0.14	0.50	USD/TRY	7.4779	0.1258	0.70
NZD/USD	0.7163	-0.0079	-0.18	USD/IDR	14,125	105	1.66	USD/SEK	8.3054	0.0640	0.62
USD/CAD	1.2784	0.0082	0.05	USD/THB	30.120	0.055	0.78	USD/NOK	8.5370	0.1171	-0.22

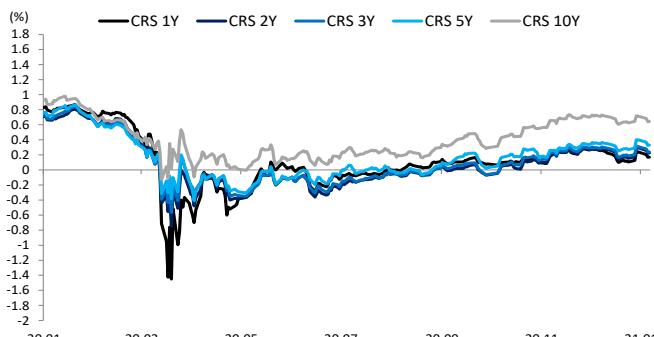
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



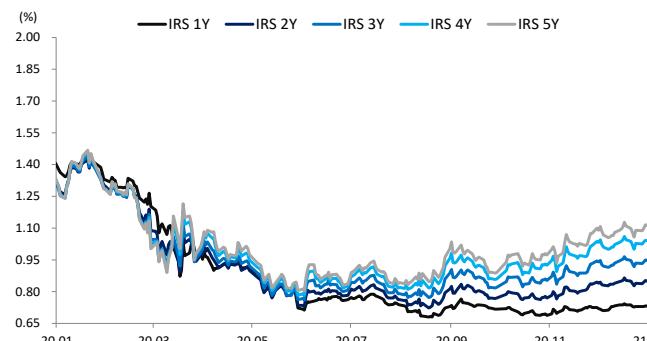
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



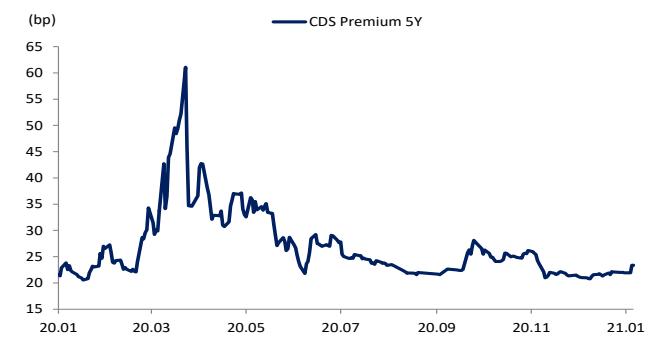
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



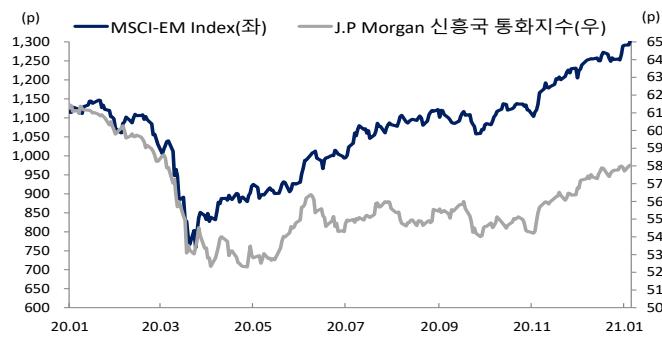
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



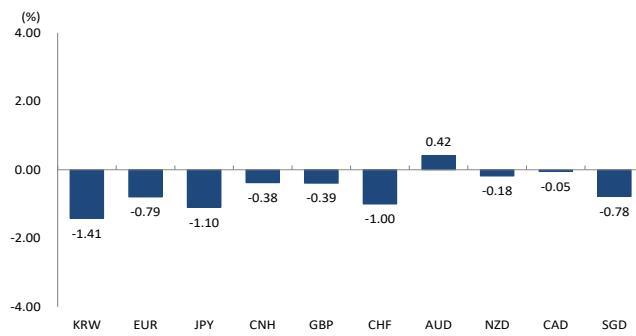
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



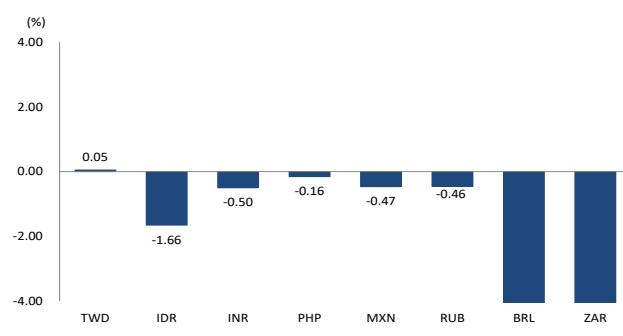
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터