

## FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

## 경기회복 기대감&amp;테이퍼링 가능성

금일 달러/원 예상 : 1,095.00~1,103.00  
 NDF 최종호가 : 1,097.80/1,098.20(+3.00)

## ◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD101	1094.90	▼4.5	3.4	480,555
USD102	1094.30	▼5.0	3.0	492,201
USD/KRW	1095.10	▼4.8	3.2	
USD/CNY	6.4552	▼0.0029	0.0083	

## ◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	90.334	-0.131	UST2Y	0.1430
EUR/USD	1.2157	-0.0050	UST10Y	1.0832
USD/JPY	103.89	0.13	UST30Y	1.8155
GBP/USD	1.3639	-0.0025	WTI	52.88

## 차트1. 달러/원 &amp; 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트2. 달러/원 &amp; 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 경제지표 및 이벤트

## 전 일(01/13)

19:00 유럽 11월 산업생산 MoM(결과:2.5%, 이전:2.1%)  
 22:30 미국 12월 CPI YoY(결과:1.4%, 이전:1.2%)

## 금 일(01/14)

08:50 일본 11월 핵심기계수주 MoM(예상:-15.2%, 이전:2.8%)  
 22:30 미국 주간실업수당청구건수(예상:787K, 이전:787K)  
 N/A 중국 12월 수출 YoY(예상:15.0%, 이전:21.1%)  
 N/A 중국 12월 수입 YoY(예상:5.4%, 이전:4.5%)

## 의 일(01/15)

16:00 영국 11월 산업생산 MoM(예상:0.5%, 이전:1.3%)  
 22:30 미국 12월 PPI YoY(예상:1.3%, 이전:1.4%)  
 22:30 미국 1월 뉴욕 제조업지수(예상:6.0, 이전:4.9)  
 22:30 미국 12월 소매판매 MoM(예상:0.0%, 이전:-1.1%)  
 23:15 미국 12월 산업생산 MoM(예상:0.5%, 이전:0.4%)

## USD Futures &amp; Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD101	1,099.40	1.90	1,099.30	1,103.00	1,097.00	6.00	391,820	-89,053	711,243	-128,499
USD102	1,099.30	2.60	1,097.70	1,102.70	1,097.00	5.70	30,919	8,039	196,241	139,819
USD SPOT	1,099.90	2.60	1,098.00	1,103.00	1,097.00	6.00	9,946	-1,353	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	385,922	367,302	18,620	17,700	-19,340
은행	41,631	40,611	1,020	4,373	75,357
투신	34,576	34,462	114	-10,278	-44,571
보험	34,899	33,505	1,394	-3,466	-10,602
기타법인	28,346	27,814	532	-4,878	-20,356
개인	47,062	51,316	-4,254	482	6,772
외국인	237,362	254,872	-17,510	-3,867	13,346

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	3,125.95	-22.50
국고채3Y	0.976	0.007
국고채10Y	1.718	0.026

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	24.803	-0.010

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	-6,202	216	-13,139
KOSDAQ	-866	-1,519	6,025
국고채	-388	-1,966	25,141
통안채	567	12,270	28,513

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.12650	-0.00075
Call	0.000	-0.570	3M	0.24125	0.00750
CD	0.660	0.000	6M	0.24788	0.00025
통안1년	0.683	0.000	12M	0.32625	0.00062

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	31,060.47	-8.22	-0.03	0.75
S&P	3,809.84	8.65	0.23	1.65
나스닥	13,128.95	56.52	0.43	3.05
FTSE 100	6,745.52	-8.59	-0.13	-1.41
DAX 30	13,939.71	14.65	0.11	0.34
Nikkei 225	28,456.59	292.25	1.04	4.78
Shanghai	3,598.65	-9.69	-0.27	1.35
항셍 H	11,184.90	-32.79	-0.29	2.62
미국채 2년	0.1430	-0.0019	-1.31	4.46
미국채 10년	1.0832	-0.0459	-4.07	4.61
WTI	52.88	-0.33	-0.62	4.44
Gold	1,855.86	16.31	0.89	-2.72

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	-0.05	0.05
3M	-0.25	0.05
6M	-0.30	0.00
12M	-0.40	-0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.190	0.005
2Y	0.215	-0.005
3Y	0.255	-0.005
4Y	0.285	-0.005
5Y	0.330	-0.005

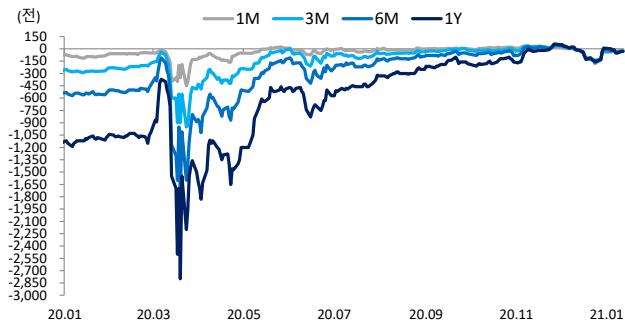
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	90.334	-0.131	0.90	USD/KRW	1,099.95	2.75	1.31	USD/RUB	73.5488	-1.1180	-0.51
EUR/USD	1.2157	-0.0050	-1.38	USD/CNY	6.4636	-0.0178	0.01	USD/BRL	5.3212	-0.1865	0.39
USD/JPY	103.89	0.13	0.82	USD/HKD	7.7537	-0.0012	0.01	USD/ZAR	15.2570	0.0221	1.25
GBP/USD	1.3639	-0.0025	0.23	USD/SGD	1.3271	0.0038	0.70	USD/MXN	19.8533	0.0629	1.04
USD/CHF	0.8878	0.0014	1.06	USD/TWD	28.238	-0.001	0.18	USD/PLN	3.7313	0.0277	1.65
AUD/USD	0.7733	-0.0039	-0.88	USD/INR	73.25	0.01	0.32	USD/TRY	7.4030	-0.0487	1.28
NZD/USD	0.7178	-0.0042	-1.59	USD/IDR	14,130	-20	1.69	USD/SEK	8.3477	0.1027	2.22
USD/CAD	1.2698	-0.0013	0.17	USD/THB	30.110	-0.010	0.76	USD/NOK	8.4730	0.0242	0.73

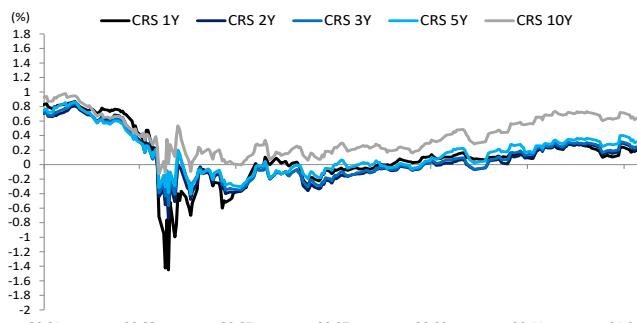
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



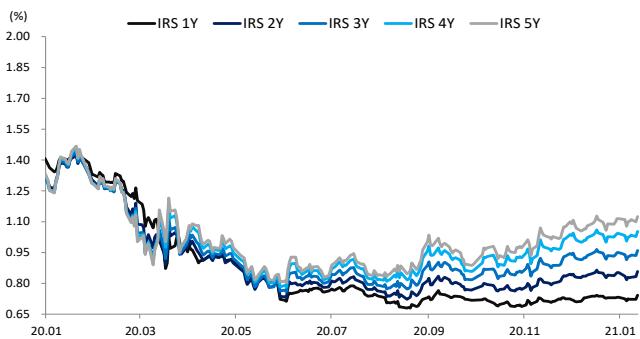
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



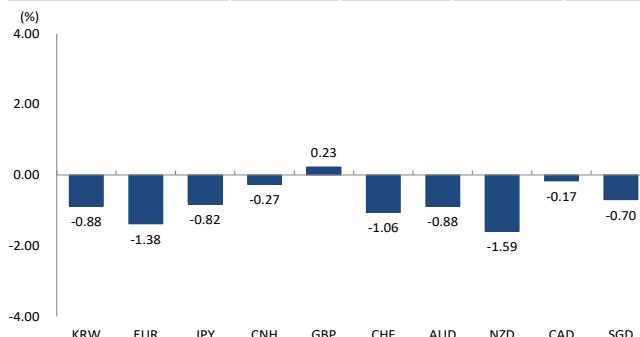
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



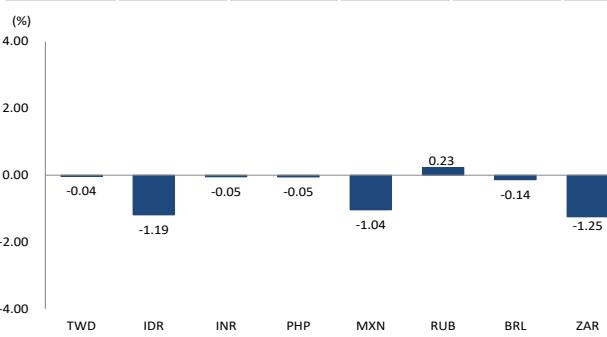
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터