

## FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

## 유로화 강세 제한 vs 美증시 최고치

금일 달러/원 예상 : 1,095.00~1,102.00  
 NDF 최종호가 : 1,098.00/1,098.30(-2.10)

## ◇ 전일 국내시장 동향

| 종목      | 전일종가    | 전일비<br>(원) | 변동폭<br>(고가-저가) | 미결제약정<br>(계약) |
|---------|---------|------------|----------------|---------------|
| USD102  | 1099.50 | ▼3.6       | 3.8            | 869,223       |
| USD103  | 1099.80 | ▼3.3       | 3.0            | 3,661         |
| USD/KRW | 1100.30 | ▼2.6       | 5.2            |               |
| USD/CNY | 6.4684  | ▼0.0029    | 0.0083         |               |

## ◇ 전일 해외시장 동향

| 종목        | 전일종가   | 전일비(bp) | 종목     | 전일종가   |
|-----------|--------|---------|--------|--------|
| USD Index | 90.469 | -0.029  | UST2Y  | 0.1270 |
| EUR/USD   | 1.2106 | -0.0023 | UST10Y | 1.0802 |
| USD/JPY   | 103.54 | -0.36   | UST30Y | 1.8296 |
| GBP/USD   | 1.3654 | 0.0024  | WTI    | 53.24  |

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(01/20)                                | 금 일(01/21)                                 | 의 일(01/22)                                  |
|---|--|---|
| 19:00 유럽 12월 CPI YoY(결과:-0.3%, 예상:-0.3%)  | 09:00 한국 1월 수출(~20일)(예상:--, 이전:1.2%)       | 08:30 일본 12월 CPI YoY(예상:-1.3%, 예상:-0.9%)    |
| 21:00 미국 MBA 주택용자신청지수(결과:-1.9%, 예상:16.7%) | 09:30 호주 12월 실업률(예상:6.7%, 예상:6.8%)         | 09:01 영국 1월 Gfk 소비자기대지수(예상:-30, 예상:-26)     |
|   | 15:00 일본 12월 공적기계수주 YoY(예상:--, 예상:8.7%)    | 09:30 호주 12월 소매판매 MoM(예상:-1.5%, 예상:7.1%)    |
|   | 21:45 ECB 통화정책회의 기준금리 결정(예상:동결)            | 16:00 영국 12월 소매판매 MoM(예상:1.3%, 예상:-3.8%)    |
|   | 22:30 미국 1월 블라델피아 연준 경기전망(예상:11.3, 예상:9.1) | 17:30 독일 1월 마켓 제조업 PMI(P)(예상:57.2, 예상:58.3) |
|   | 22:30 미국 주간실업수당 청구건수(예상:923k, 예상:965k)     | 18:00 유럽 1월 마켓 제조업 PMI(P)(예상:54.4, 예상:55.2) |
|   | 22:30 미국 12월 건축허가(예상:1603k, 예상:1635k)      | 23:45 미국 1월 마켓 제조업 PMI(P)(예상:56.5, 예상:57.1) |

## USD Futures &amp; Spot

| 종목       | 종가       | 전일비   | 시가       | 고가       | 저가       | 변동폭  | 거래량     | 전일대비   | 미결제약정   | 전일대비   |
|----------|----------|-------|----------|----------|----------|------|---------|--------|---------|--------|
| USD102   | 1,099.50 | -3.60 | 1,101.00 | 1,102.00 | 1,098.20 | 3.80 | 278,678 | 27,568 | 869,223 | -3,929 |
| USD103   | 1,099.80 | -3.30 | 1,100.80 | 1,101.40 | 1,098.40 | 3.00 | 3,492   | 1,985  | 3,661   | 2,220  |
| USD SPOT | 1,100.30 | -2.60 | 1,103.50 | 1,103.50 | 1,098.30 | 5.20 | 7,468   | -474   | -       | -      |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## USD Futures 전일 투자자별 매매동향

| 구분   | 매수      | 매도      | 순매수     | 5일누적    | 20일누적   |
|------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 금융투자 | 85,859  | 76,540  | 9,319   | 9,953   | 403     |
| 은행   | 14,891  | 373     | 14,518  | 44,142  | 111,422 |
| 투신   | 628     | 5,186   | -4,558  | -6,295  | -45,627 |
| 보험   | 64      | 1,315   | -1,251  | -1,888  | -12,011 |
| 기타법인 | 12,008  | 8,140   | 3,868   | -2,376  | -6,302  |
| 개인   | 32,544  | 28,398  | 4,146   | 911     | 6,633   |
| 외국인  | 138,727 | 165,462 | -26,735 | -44,650 | -54,680 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 국내 시장 동향

| 종목     | 주가/금리    | 전일비    |
|--------|----------|--------|
| KOSPI  | 3,114.55 | 21.89  |
| 국고채3Y  | 0.976    | 0.002  |
| 국고채10Y | 1.703    | -0.008 |
| 신용지표   |          |        |
| 만기     | Mid      | 전일비    |
| CDS 5Y | 24.045   | -1.101 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 외국인 증권투자동향

| 종목     | 순매수    | 5일 누적  | 20일누적  |
|--------|--------|--------|--------|
| KOSPI  | -2,360 | -1,115 | 213    |
| KOSDAQ | 2,672  | 4,555  | 8,365  |
| 국고채    | -879   | -6,106 | 2,363  |
| 통안채    | 0      | 5,784  | 31,456 |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## Korea - US 금리

| Korea | 종가    | 전일비   | US Libor | 종가      | 전일비      |
|-------|-------|-------|----------|---------|----------|
| 기준    | 0.500 | 0.000 | 1M       | 0.12950 | -0.00138 |
| Call  | 0.530 | 0.060 | 3M       | 0.22363 | -0.00037 |
| CD    | 0.690 | 0.000 | 6M       | 0.23588 | 0.00013  |
| 통안1년  | 0.678 | 0.001 | 12M      | 0.31300 | 0.00062  |

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 글로벌 금융시장

| 종목         | 종가        | 전일비     | 전일비(%) | 1주(%)  |
|------------|-----------|---------|--------|--------|
| 다우지수       | 31,188.38 | 257.86  | 0.83   | 0.39   |
| S&P        | 3,851.85  | 52.94   | 1.39   | 1.33   |
| 나스닥        | 13,457.25 | 260.07  | 1.97   | 2.94   |
| FTSE 100   | 6,740.39  | 27.44   | 0.41   | -0.08  |
| DAX 30     | 13,921.37 | 106.31  | 0.77   | -0.13  |
| Nikkei 225 | 28,523.26 | -110.20 | -0.38  | 0.23   |
| Shanghai   | 3,583.09  | 16.71   | 0.47   | -0.43  |
| 항셍 H       | 11,949.35 | 215.02  | 1.83   | 6.83   |
| 미국채 2년     | 0.1270    | -0.0040 | -3.05  | -11.19 |
| 미국채 10년    | 1.0802    | -0.0084 | -0.77  | -0.28  |
| WTI        | 53.24     | 0.26    | 0.49   | 0.06   |
| Gold       | 1,863.23  | 20.41   | 1.11   | 0.40   |

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

## FX Swap points

| 만기  | Mid   | 전일비   |
|-----|-------|-------|
| 1M  | -0.05 | 0.05  |
| 3M  | -0.30 | 0.10  |
| 6M  | -0.50 | 0.10  |
| 12M | -0.90 | 0.30  |
| CRS |       |       |
| 만기  | Mid   | 전일비   |
| 1Y  | 0.155 | 0.020 |
| 2Y  | 0.190 | 0.020 |
| 3Y  | 0.235 | 0.020 |
| 4Y  | 0.275 | 0.015 |
| 5Y  | 0.340 | 0.025 |

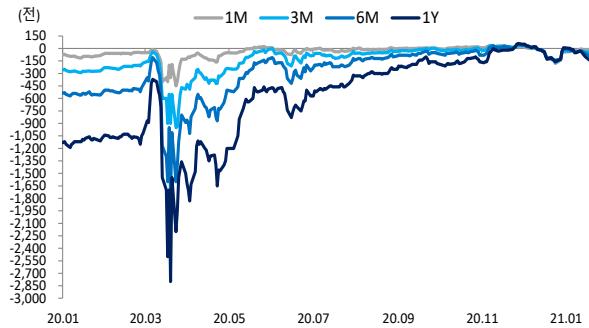
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 주요 통화 \*영업일 기준으로 집계

| 아시아 통화    |        |         |       |         | 기타 통화    |         |       |         |         |         |       |
|-----------|--------|---------|-------|---------|----------|---------|-------|---------|---------|---------|-------|
| 종목        | 종가     | 전일비     | 1주(%) | 종목      | 종가       | 전일비     | 1주(%) | 종목      | 종가      | 전일비     | 1주(%) |
| USD Index | 90.469 | -0.029  | 0.13  | USD/KRW | 1,100.20 | -2.70   | 0.45  | USD/RUB | 73.5068 | -0.1713 | -0.34 |
| EUR/USD   | 1.2106 | -0.0023 | -0.42 | USD/CNY | 6.4656   | -0.0135 | -0.04 | USD/BRL | 5.3083  | -0.0435 | 0.01  |
| USD/JPY   | 103.54 | -0.36   | -0.34 | USD/HKD | 7.7518   | -0.0006 | -0.02 | USD/ZAR | 14.9051 | -0.0806 | -2.31 |
| GBP/USD   | 1.3654 | 0.0024  | 0.11  | USD/SGD | 1.3248   | -0.0046 | -0.17 | USD/MXN | 19.6045 | -0.0676 | -1.25 |
| USD/CHF   | 0.8897 | 0.0011  | 0.21  | USD/TWD | 28.206   | -0.021  | 0.03  | USD/PLN | 3.7454  | 0.0068  | 0.38  |
| AUD/USD   | 0.7747 | 0.0052  | 0.18  | USD/INR | 73.03    | -0.14   | -0.17 | USD/TRY | 7.4248  | -0.0470 | 0.29  |
| NZD/USD   | 0.7172 | 0.0050  | -0.08 | USD/IDR | 14,035   | -30     | -0.18 | USD/SEK | 8.3530  | 0.0036  | 0.06  |
| USD/CAD   | 1.2636 | -0.0099 | -0.49 | USD/THB | 29.983   | -0.052  | -0.23 | USD/NOK | 8.4937  | -0.0483 | 0.24  |

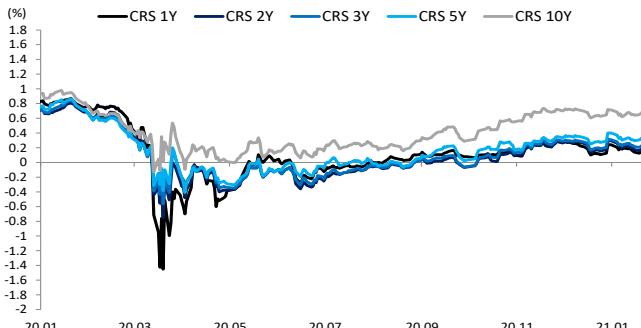
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. FX Swap Point



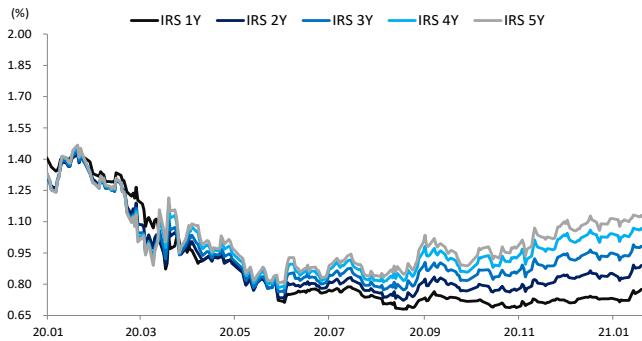
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

## 차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 달러/위안



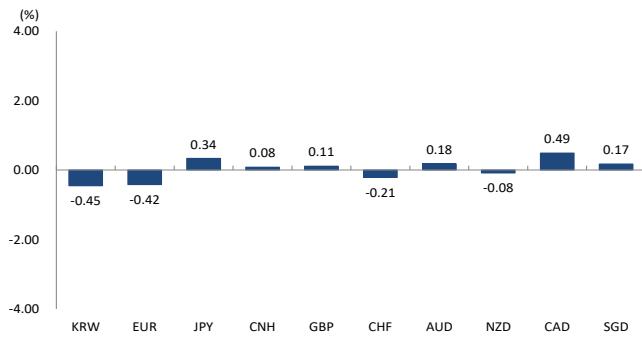
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 신흥국 주가지수 &amp; 통화 지수



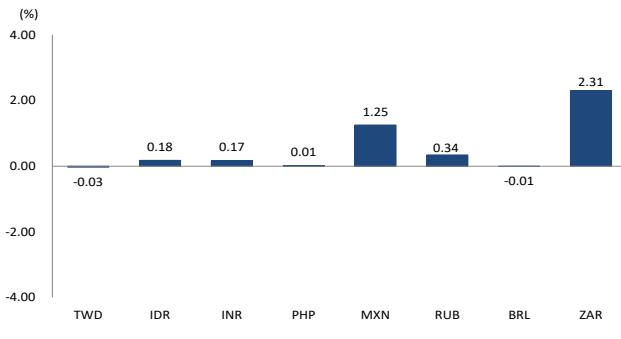
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

## 차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터