

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

美정권 개시&양호한 지표, 리스크 온

금일 달러/원 예상 : 1,095.00~1,103.00
 NDF 최종호가 : 1,099.90/1,100.10(+2.30)

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD102	1098.20	▼1.3	3.7	872,380
USD103	1098.70	▼1.1	4.0	4,001
USD/KRW	1098.20	▼2.1	3.7	
USD/CNY	6.4605	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	90.092	-0.383	UST2Y	0.1189
EUR/USD	1.2164	0.0058	UST10Y	1.1058
USD/JPY	103.50	-0.04	UST30Y	1.8692
GBP/USD	1.3733	0.0079	WTI	53.13

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(01/21)

- 21:45 ECB 통화정책회의 기준금리 결정(결과:동결)
- 22:30 미국 1월 필라델피아 연준 경기전망(결과:26.5, 이전:9.1)
- 22:30 미국 주간실업수당 청구건수(결과:900k, 이전:965k)
- 22:30 미국 12월 건축허가(결과:1709k, 이전:1635k)

금 일(01/22)

- 08:30 일본 12월 CPI YoY(예상:-1.3%, 이전:-0.9%)
- 09:01 영국 1월 Gfk 소비자기대지수(예상:-30, 이전:-26)
- 09:30 호주 12월 소매판매 MoM(예상:-1.5%, 이전:7.1%)
- 16:00 영국 12월 소매판매 MoM(예상:1.3%, 이전:-3.8%)
- 17:30 독일 1월 마킷 제조업 PMI(P)(예상:57.2, 이전:58.3)
- 18:00 유럽 1월 마킷 제조업 PMI(P)(예상:54.4, 이전:55.2)
- 23:45 미국 1월 마킷 제조업 PMI(P)(예상:56.5, 이전:57.1)

의 일(01/25)

- 18:00 독일 1월 IFO 기업환경지수(예상:--, 이전:92.1)
- 22:30 미국 12월 시카고 연방 국가활동지수(예상:--, 이전:0.27)
- 00:30 미국 1월 델러스 연준 제조업 활동(예상:--, 이전:9.7)

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD102	1,098.20	-1.30	1,097.40	1,101.10	1,097.40	3.70	247,716	-34,117	872,380	3,157
USD103	1,098.70	-1.10	1,097.80	1,101.00	1,097.00	4.00	2,012	-1,480	4,001	340
USD SPOT	1,098.20	-2.10	1,099.00	1,101.20	1,097.50	3.70	7,385	-83	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	62,076	72,021	-9,945	10,649	-27,314
은행	9,743	1,002	8,741	55,740	116,357
투신	2,419	5,229	-2,810	-7,746	-33,406
보험	258	3,112	-2,854	-4,408	-14,608
기타법인	7,782	4,671	3,111	2,049	-298
개인	20,909	25,140	-4,231	-900	691
외국인	146,453	138,085	8,368	-55,407	-41,204

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	3,160.84	46.29
국고채3Y	0.974	-0.002
국고채10Y	1.711	0.008

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	24.592	-0.081

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	2,289	-5,610	2,601
KOSDAQ	-1,356	2,690	6,207
국고채	3,460	-3,592	3,386
통안채	302	5,284	24,054

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.13000	0.00150
Call	0.000	-0.330	3M	0.21775	-0.00463
CD	0.690	0.000	6M	0.23450	-0.00338
통안1년	0.679	0.001	12M	0.31538	-0.00187

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	31,176.01	-12.37	-0.04	0.37
S&P	3,853.07	1.22	0.03	1.13
나스닥	13,530.92	73.67	0.55	3.06
FTSE 100	6,715.42	-24.97	-0.37	-1.27
DAX 30	13,906.67	-14.70	-0.11	-0.59
Nikkei 225	28,756.86	233.60	0.82	0.20
Shanghai	3,621.26	38.17	1.07	1.55
항셍 H	11,889.45	-59.90	-0.50	5.22
미국채 2년	0.1189	-0.0081	-6.38	-14.46
미국채 10년	1.1058	0.0256	2.37	-2.07
WTI	53.13	-0.11	-0.21	0.42
Gold	1,864.85	1.62	0.09	0.51

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.00	0.05
3M	-0.15	0.15
6M	-0.30	0.20
12M	-0.80	0.10

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.155	0.000
2Y	0.190	0.000
3Y	0.235	0.000
4Y	0.275	0.000
5Y	0.340	0.000

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	90.092	-0.383	-0.16	USD/KRW	1,098.25	-1.95	0.02	USD/RUB	73.8465	0.3397	0.84
EUR/USD	1.2164	0.0058	0.07	USD/CNY	6.4620	-0.0036	-0.19	USD/BRL	5.3605	0.0522	2.98
USD/JPY	103.50	-0.04	-0.29	USD/HKD	7.7518	0.0000	-0.02	USD/ZAR	14.9431	0.0380	-0.99
GBP/USD	1.3733	0.0079	0.32	USD/SGD	1.3228	-0.0020	-0.20	USD/MXN	19.7313	0.1268	0.18
USD/CHF	0.8853	-0.0044	-0.33	USD/TWD	28.172	-0.034	-0.15	USD/PLN	3.7270	-0.0184	-0.28
AUD/USD	0.7764	0.0017	-0.18	USD/INR	73.00	-0.03	-0.07	USD/TRY	7.3710	-0.0538	0.08
NZD/USD	0.7216	0.0044	0.07	USD/IDR	14,000	-35	-0.42	USD/SEK	8.2719	-0.0811	-0.44
USD/CAD	1.2637	0.0001	-0.02	USD/THB	29.930	-0.053	-0.19	USD/NOK	8.4135	-0.0802	-0.59

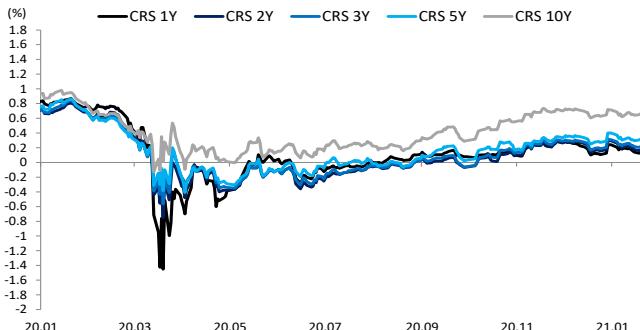
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



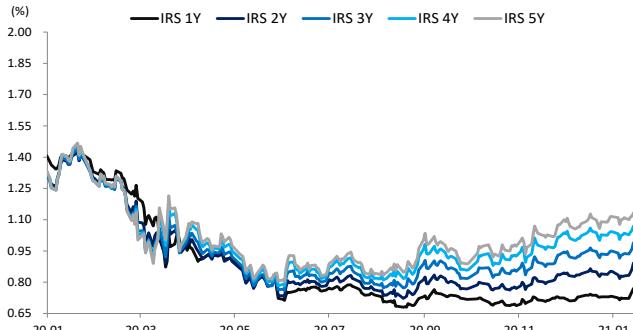
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



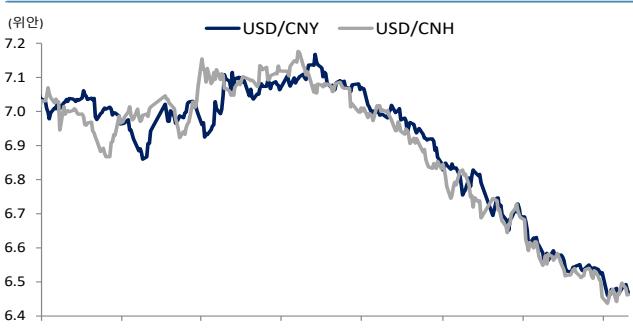
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



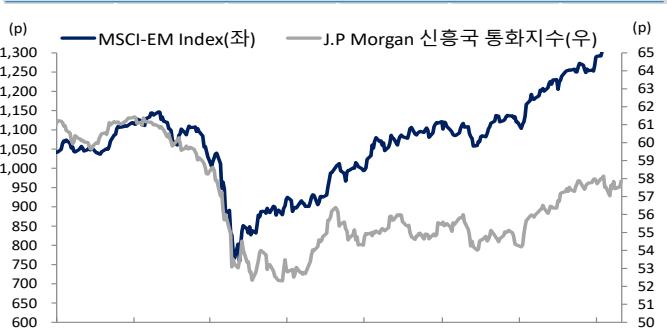
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



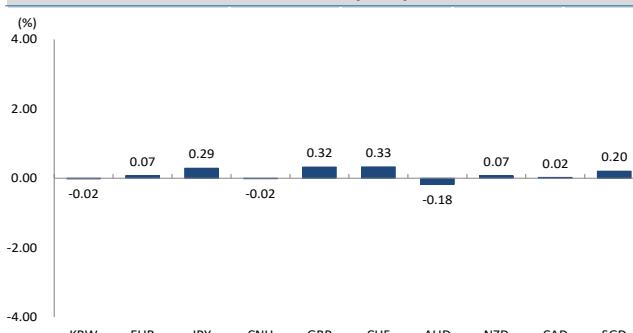
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



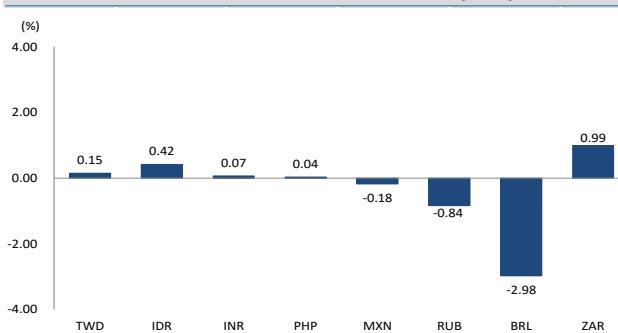
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터