

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

美 부양안 기대vs코로나 터널 속 유럽

금일 달러/원 예상 : 1,111.00~1,119.00
 NDF 최종호가 : 1,115.30/1,115.70(-2.10)

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD102	1117.50	▲1.4	4.9	894,506
USD103	1117.20	▲1.1	4.7	7,683
USD/KRW	1117.70	▲1.2	5.5	
USD/CNY	6.4605	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	91.043	0.063	UST2Y	0.1132
EUR/USD	1.2044	-0.0016	UST10Y	1.0963
USD/JPY	104.98	0.05	UST30Y	1.8694
GBP/USD	1.3668	0.0005	WTI	55.06

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(02/02)

19:00 유럽 4분기 GDP QoQ(결과:-0.7%, 예상:12.5%)
 (02/03)
 04:00 Fed 로레타메스터 클리블랜드 총재 연설

금 일(02/03)

06:00 한국 1월 외환보유고(예상:--, 이전:\$443.10)
 10:45 중국 1월 차이신 서비스업 PMI(예상:55.5, 이전:56.3)
 17:55 독일 1월 마켓 서비스업 PMI(예상:46.8, 이전:46.8)
 18:30 유럽 1월 마켓 서비스업 PMI(예상:45.0, 이전:45.0)
 00:00 미국 1월 ISM 서비스지수(예상:56.7, 이전:57.7)
 00:30 미국 DOE 주간원유재고(예상:--, 이전:-9910K)

의 일(02/04)

17:30 독일 1월 마켓 건설 PMI(예상:--, 이전:47.1)
 18:30 영국 1월 마켓 PMI(예상:52.8, 이전:54.6)
 19:00 유럽 12월 소매판매 MoM(예상:2.3%, 이전:-6.1%)
 21:00 BOE 통화정책회의 기준금리 결정(예상:동결)
 22:30 미국 주간 신규실업수당 청구건수(예상:830K, 이전:847K)
 00:00 미국 12월 내구재 주문(예상:0.2%, 이전:0.2%)
 00:00 미국 12월 제조업 수주(예상:0.7%, 이전:1.0%)

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD102	1,117.50	1.40	1,116.40	1,119.20	1,114.30	4.90	285,175	-49,114	894,618	18,523
USD103	1,117.20	1.10	1,117.00	1,119.00	1,114.30	4.70	4,943	-171	7,683	-171
USD SPOT	1,117.70	1.20	1,117.00	1,119.50	1,114.00	5.50	8,277	-1,252	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	97,164	100,330	-3,166	-30,492	-33,783
은행	7,947	1,835	6,112	24,512	137,702
투신	1,326	2,865	-1,539	11,307	-36,347
보험	479	339	140	5,972	-1,067
기타법인	7,308	8,027	-719	-9,307	-12,637
개인	30,602	32,940	-2,338	-2,097	-8,415
외국인	145,048	143,308	1,740	105	-45,705

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	3,096.81	40.28
국고채3Y	0.980	-0.014
국고채10Y	1.758	-0.045
신용지표		
만기	Mid	전일비
CDS 5Y	23.501	-1.708

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	1,966	-32,821	-47,684
KOSDAQ	-373	-899	-752
국고채	2,341	23,956	24,134
통안채	1,003	16,259	42,466

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.11525	0.00225
Call	0.480	0.000	3M	0.19225	-0.00325
CD	0.730	0.030	6M	0.21713	0.00213
통안1년	0.690	-0.010	12M	0.30413	-0.00137

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	30,687.48	475.57	1.57	-0.81
S&P	3,826.31	52.45	1.39	-0.61
나스닥	13,612.78	209.39	1.56	-0.10
FTSE 100	6,516.65	50.23	0.78	-2.06
DAX 30	13,835.16	213.14	1.56	-0.26
Nikkei 225	28,362.17	271.12	0.97	-0.64
Shanghai	3,533.69	28.40	0.81	-1.00
항셍 H	11,609.02	154.84	1.35	-0.74
미국채 2년	0.1132	0.0059	5.50	-6.52
미국채 10년	1.0963	0.0171	1.58	5.95
WTI	55.06	1.51	2.82	4.66
Gold	1,835.24	-29.65	-1.59	-0.94

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

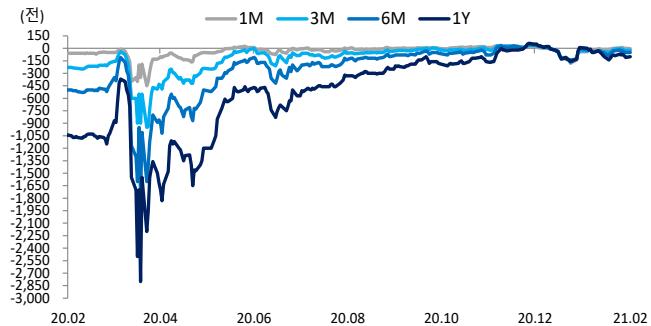
만기	Mid	전일비
1M	-0.10	-0.05
3M	-0.30	-0.05
6M	-0.50	0.00
12M	-0.90	0.10
CRS		
만기	Mid	전일비
1Y	0.145	0.010
2Y	0.225	0.035
3Y	0.260	0.040
4Y	0.310	0.045
5Y	0.390	0.040

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

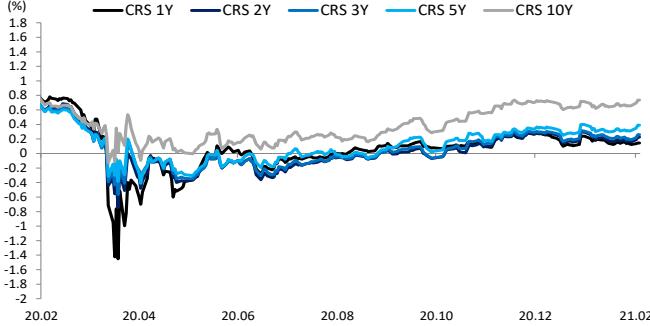
아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	91.043	0.063	0.97	USD/KRW	1,117.45	1.25	0.99	USD/RUB	76.2303	0.0843	1.50
EUR/USD	1.2044	-0.0016	-0.95	USD/CNY	6.4574	-0.0105	-0.12	USD/BRL	5.3594	-0.0863	0.17
USD/JPY	104.98	0.05	1.31	USD/HKD	7.7517	-0.0012	-0.00	USD/ZAR	14.9660	-0.1034	-0.68
GBP/USD	1.3668	0.0005	-0.50	USD/SGD	1.3322	-0.0007	0.57	USD/MXN	20.1360	-0.2535	0.75
USD/CHF	0.8973	0.0003	1.17	USD/TWD	28.180	0.002	-0.07	USD/PLN	3.7210	-0.0189	-0.47
AUD/USD	0.7607	-0.0014	-1.81	USD/INR	72.97	-0.06	0.03	USD/TRY	7.1866	-0.0063	-2.19
NZD/USD	0.7192	0.0034	-0.61	USD/IDR	14,025	2	-0.28	USD/SEK	8.3974	-0.0302	1.17
USD/CAD	1.2781	-0.0070	0.69	USD/THB	29.985	0.013	-0.01	USD/NOK	8.6029	-0.0059	0.67

차트. FX Swap Point



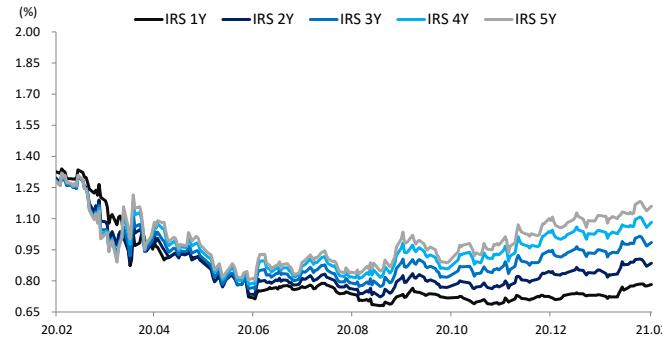
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



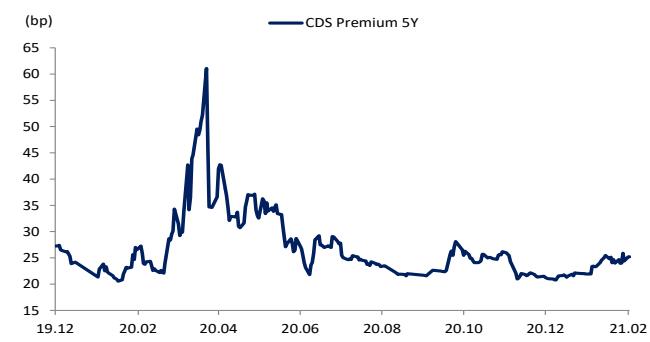
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



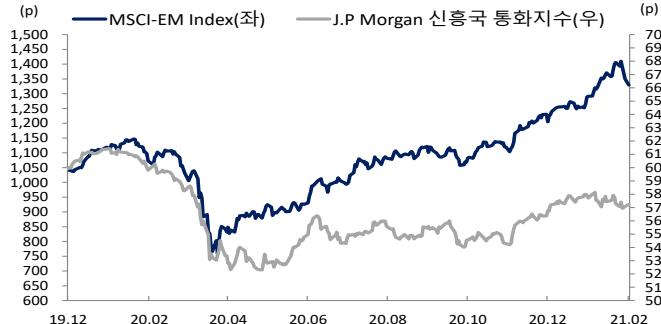
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



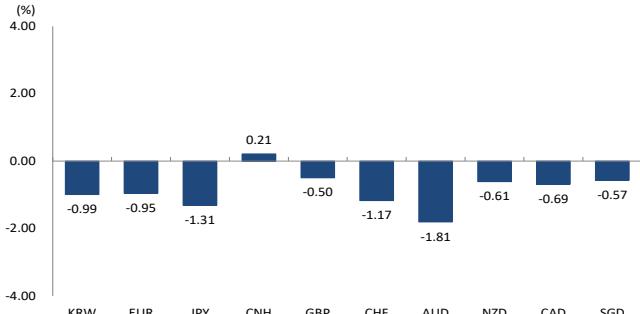
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



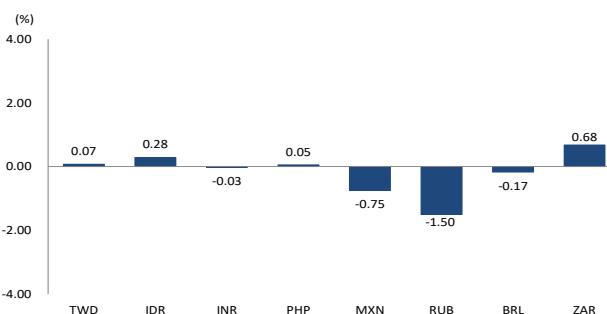
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터