

FX / 소병은

☎ 82-2-3774-0451

✉ beso@futures.co.kr

록다운 해제 개시, 파운드 강세

금일 달러/원 예상 : 1,098.00~1,115.00

NDF 최종호가 : 1,102.30/1,102.70(+1.10)

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일증가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD104	1101.50	▼5.5	3.8	469
USD103	1101.30	▼6.1	12.1	891,054
USD/KRW	1101.40	▼5.6	4.4	
USD/CNY	6.4581	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일증가	전일비(bp)	종목	전일증가
USD Index	90.372	0.001	UST2Y	0.1090
EUR/USD	1.2129	0.0011	UST10Y	1.2082
USD/JPY	105.38	0.79	UST30Y	2.0086
GBP/USD	1.3903	0.0069	WTI	60.12

전일 국내 동향

전일 대비 2.0원 내린 1105원에 개장한 환율은 개장전 발표한 한국 2월(1일~10일)수출 지표 호조에 외국인 주식 순매수세가 이어짐. 이에 환율은 약보권에서 등락. 이월 네고 소진에 따른 결제 수요 영향력이 확대되며 환율은 1105원에서 좁은 폭 등락. 중국 춘절 연휴 휴장 속 국내 코로나 19 신규 확진자수가 300명대를 유지하며 환율은 하락 우위의 흐름을 이어갔음. 이후 환율은 1100원대까지 내려가며 1101.4원까지 저점을 낮춤. 오후 들어증시 상승세 둔화되며 좁은 폭 등락하다 전일 대비 5.6원 내린 1101.4원에 마감.

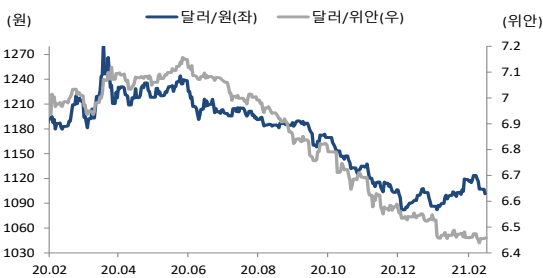
전일 해외 동향

뉴욕시장 "대통령의 날" 휴장
달러화는 파운드화 강세에 따른 유로화 상승과 경기회복 기대로 인한 위험선호가 우위를 보이며 하락.

파운드화는 보리스 존슨 영국총리의 락다운 종료와 등교 개시에 대한 의지를 소화하며 1.39달러까지 고점을 높임. 영국 보리스 존슨 총리는 뉴스 인터뷰에서 모임, 쇼핑과 여행, 일자리 분야까지 록다운 해제를 점차 개시할 것이라고 발표. 이번 "록다운이 마지막이길 바란다" 전했으며, 영국은 3월 8일부로 등교 개시를 시작해 정확한 일정은 2월 22일부로 발표될 예정. 보리스 존슨 행정부의 빠른 백신 보급과 코로나 19로 인한 최악의 경기침체로부터의 회복을 앞두고 파운드화는 강세 마감.

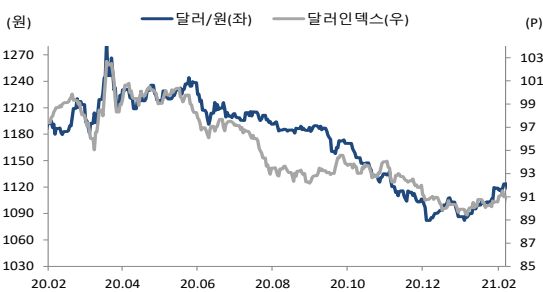
국제유가는 미국 텍사스 지역의 한파로 원유 수요가 급증했고, 미국내 가장 큰 세일 유전에서 전기부족으로 원유 공급에 차질이 발생하며 급등. WTI선물은 배럴당 \$60.86까지, 브랜드유는 전일 대비 1.3% 상승해 63.68달러까지 고점을 높임.

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

전일 국내 동향

금일 환율은 주요국의 빠른 백신 보급으로 글로벌 경기 회복 기대감이 우위를 보이며 상대적 글로벌 달러 약세에 연동해 하락 우위를 전망.

전일 엔화는 일본에서 미국 화이자 제약사의 코로나 19 백신 사용을 정식 승인한 점에 이어, 일본 4분기 GDP는 연율기준 전년대비 12.7% 상승하며 강세 폭을 키웠음. 간밤 국제유가 급등과 파운드 강세 등 위험선호신호가 강한 점에 연동해 전일 30년래 최고치 급등한 도쿄 증시 상승세 지속될 수 있음. 이는 엔화 강세로 인한 달러화 약세 요인. 다만 간밤 대통령의 날로 뉴욕 금융시장이 휴장한 만큼 금일 환시 조용한 모습 보여질 수 있는 점 유의.

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(02/15)	금 일(02/16)	익 일(02/17)
19:00 유럽 12월 무역수지(결과:27.5b, 이전:25.1b)	19:00 독일 2월 ZEW경제심리지수(예상--, 이전:61.8)	22:30 미국 1월 PPI YoY(예상:1.1%, 이전:1.2%)
	19:00 유럽 4분기 GDP QoQ(예상--, 이전:-5.1%)	22:30 미국 1월 소매판매 MoM(예상:0.9%, 이전:-1.4%)
	19:00 유럽 2월 ZEW경제심리지수(예상--, 이전:58.3)	23:15 미국 1월 산업생산 MoM(예상:0.4%, 이전:1.6%)
	22:30 미국 2월 뉴욕 제조업지수(예상:5.0, 이전:3.5)	00:00 미국 2월 NAHB주택시장지수(예상:83, 이전:83)

USD Futures & Spot

(단위 : 원, 계약, 백만달러)

종목	증가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD104	1,101.50	-5.50	1,104.00	1,105.30	1,101.50	3.80	372	310	469	294
USD103	1,101.30	-6.10	1,105.00	1,105.50	1,093.40	12.10	195,401	78,054	891,054	6,480
USD SPOT	1,101.40	-5.60	1,105.00	1,105.80	1,101.40	4.40	7,367	-2,095	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

(단위 : 계약)

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	132,733	145,945	-13,212	26,106	-15,439
은행	46,931	33,487	13,444	-37,020	76,106
투신	1,595	1,499	96	-4,916	-33,238
보험	6	882	-876	-5,367	-4,982
기타법인	8,787	5,634	3,153	7,555	870
개인	28,672	24,238	4,434	22,126	16,064
외국인	113,028	120,167	-7,139	-8,222	-39,422

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

(단위 : pt, % , %p)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	3,147.00	46.42
국고채3Y	0.998	0.003
국고채10Y	1.871	0.040

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

(단위 : bp)

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	22.410	-0.078

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

(단위 : 억원)

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	7,279	10,890	-47,861
KOSDAQ	951	898	-211
국고채	3,511	3,936	38,312
통안채	3,379	19,505	53,772

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

(단위 : % , %p)

Korea	증가	전일비	US Libor	증가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.10575	-0.00163
Call	0.400	-0.300	3M	0.19150	-0.00225
CD	0.730	0.000	6M	0.20488	0.00413
통안1년	0.686	0.002	12M	0.30050	0.00075

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	증가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	31,458.40	27.70	0.09	1.00
S&P	3,934.83	18.45	0.47	1.23
나스닥	14,095.47	69.70	0.50	1.73
FTSE 100	6,756.11	166.32	2.52	3.57
DAX 30	14,109.48	59.59	0.42	0.35
Nikkei 225	30,084.15	564.08	1.91	4.53
Shanghai	3,655.09	51.60	1.43	3.92
항셱 H	11,880.49	70.24	0.59	2.74
미국채 2년	0.1090	0.0000	0.00	-1.89
미국채 10년	1.2082	0.0000	0.00	3.22
WTI	60.12	0.65	1.09	3.71
Gold	1,818.96	-5.27	-0.29	-0.76

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

(단위 : 원)

만기	Mid	전일비
1M	0.00	-0.05
3M	-0.25	0.00
6M	-0.60	-0.20
12M	-1.00	-0.20

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

(단위 : % , %p)

만기	Mid	전일비
1Y	0.130	0.000
2Y	0.205	0.000
3Y	0.285	0.030
4Y	0.340	0.043
5Y	0.450	0.055

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

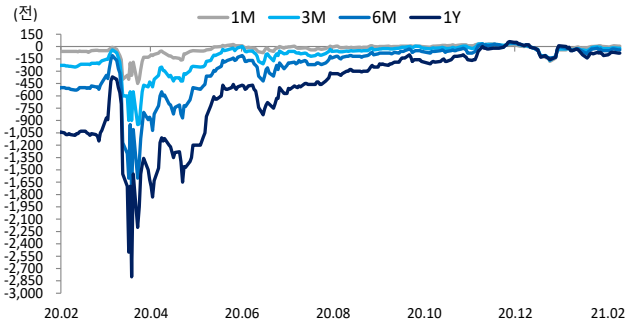
주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화

기타 통화

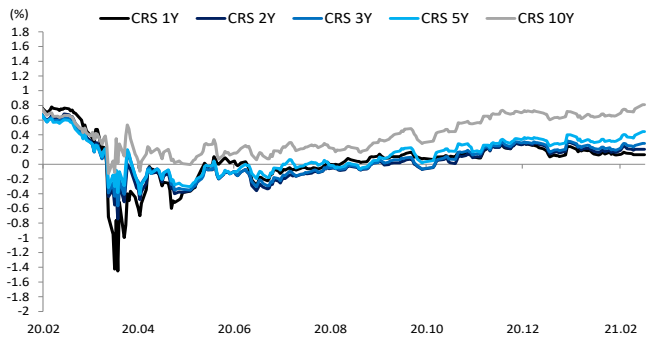
종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)	종목	증가	전일비	1주(%)
USD Index	90.372	0.001	-0.62	USD/KRW	1,101.50	-5.35	-1.62	USD/RUB	73.3385	-0.6010	-1.29
EUR/USD	1.2129	0.0011	0.66	USD/CNY	6.4583	0.0230	0.15	USD/BRL	5.3847	0.0023	0.51
USD/JPY	105.38	0.79	0.14	USD/HKD	7.7527	0.0005	0.01	USD/ZAR	14.4557	-0.2981	-2.83
GBP/USD	1.3903	0.0069	1.18	USD/SGD	1.3231	-0.0031	-0.72	USD/MXN	19.9642	-0.0787	-0.73
USD/CHF	0.8903	-0.0001	-0.96	USD/TWD	28.180	-0.010	-0.04	USD/PLN	3.6970	-0.0099	-0.48
AUD/USD	0.7781	0.0059	1.03	USD/INR	72.69	-0.16	-0.38	USD/TRY	6.9642	-0.0947	-1.54
NZD/USD	0.7227	0.0011	0.06	USD/IDR	13,910	-73	-0.66	USD/SEK	8.2819	-0.0384	-1.27
USD/CAD	1.2639	-0.0062	-0.78	USD/THB	29.888	-0.032	-0.47	USD/NOK	8.3903	-0.0738	-1.31

차트. FX Swap Point



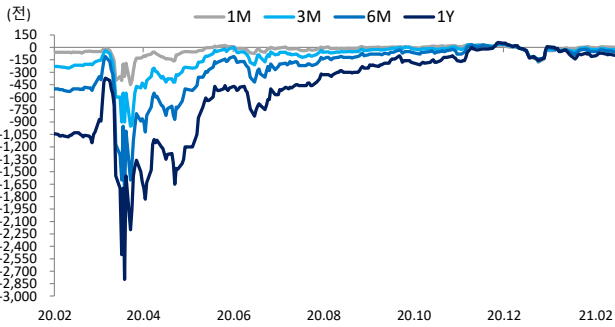
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



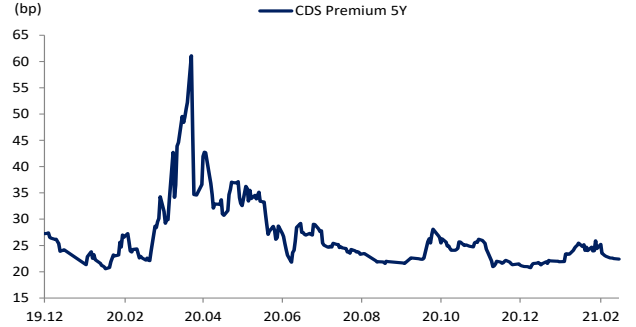
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



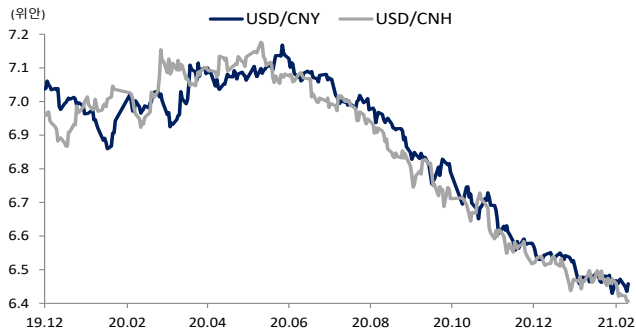
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



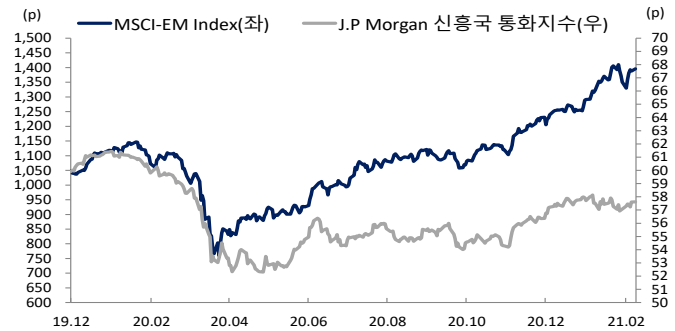
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



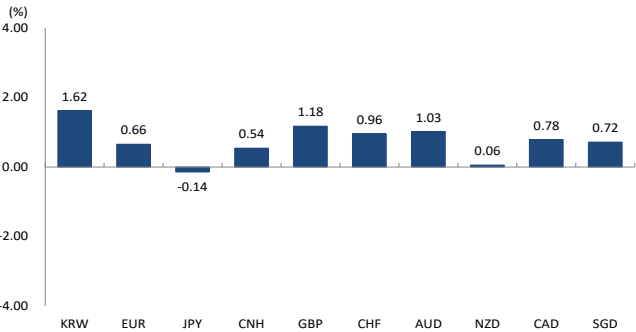
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



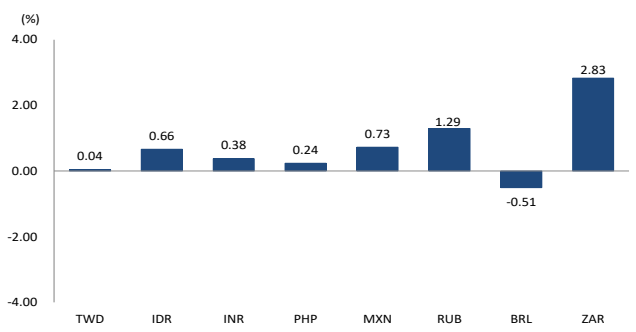
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

본 자료는 투자의 이해를 돕기 위해 참고가 되는 정보 제공을 목적으로 작성되었습니다. 당사 고객들에게 배포되는 자료로서 본 조사자료의 내용은 당사의 리서치센터에서 신뢰할 수 있는 자료와 정보를 이용하여 작성한 것이나, 당사는 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없습니다. 투자자는 자신의 판단과 책임하에 투자를 하여야 하며, 본 자료는 투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙자료로 사용될 수 없습니다. 그리고 파생상품은 높은 가격변동성으로 인해 단기간에 투자원금의 전부 또는 상당부분을 손실할 수 있습니다. 본 자료는 당사 홈페이지(www.futures.co.kr) 에서도 이용하실 수 있습니다.