현대차증권

2021년 1월 27일

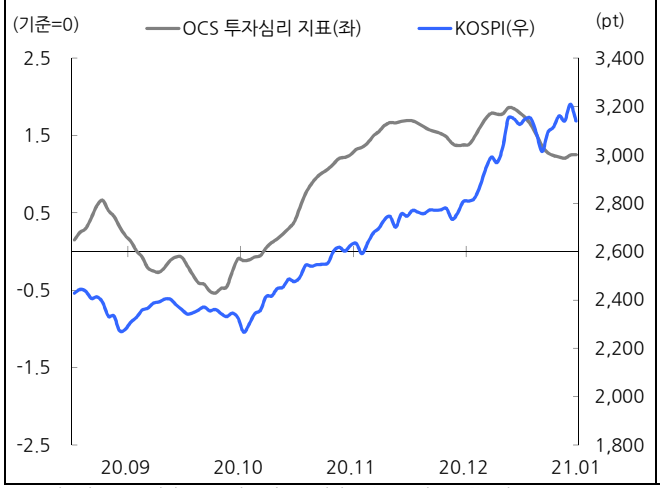
Volatility Trading Monitor

Macro Economy Strategy 오 창 섭
+82-2-3787-2385
cs.oh@hmsec.com

자산가격 투자심리 지표

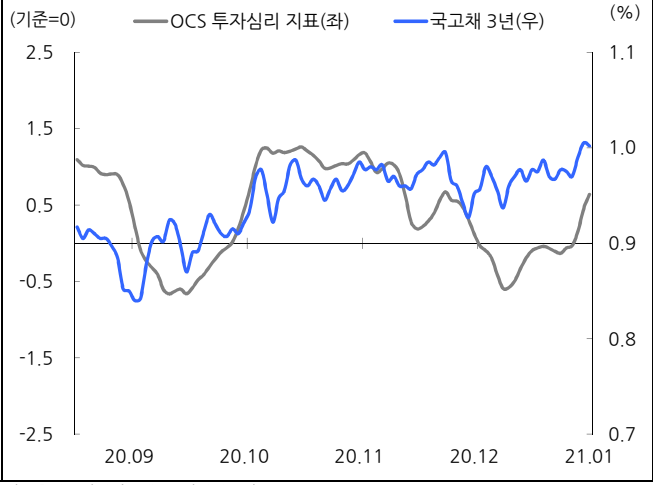
Macro Economy Strategy 오 창 섭
2021년 1월 27일

KOSPI vs. 자산가격 투자심리 지표



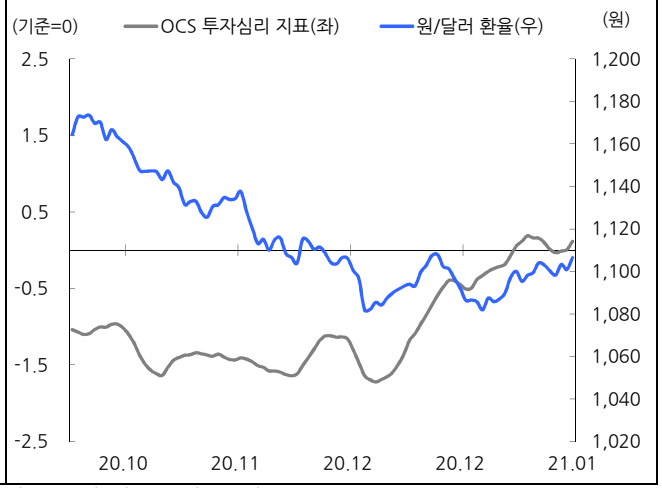
주: 투자심리 지표는 시장의 변곡점을 이용한 단기 매매차익 전략에 활용하는 지표
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

국고채 3년 vs. 자산가격 투자심리 지표



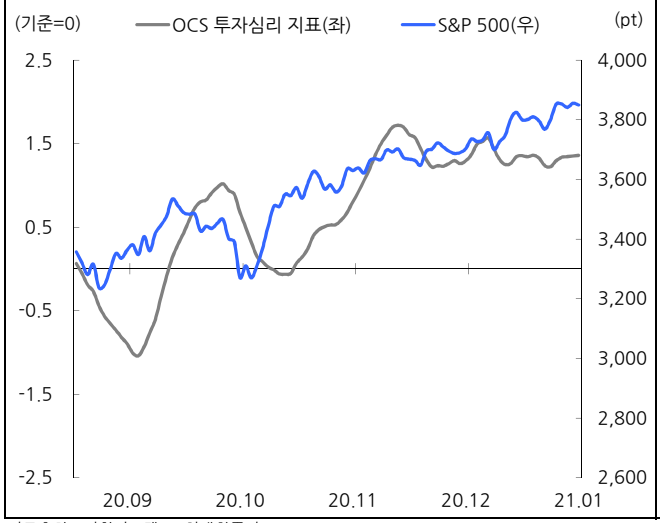
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

원/달러 환율 vs. 자산가격 투자심리 지표



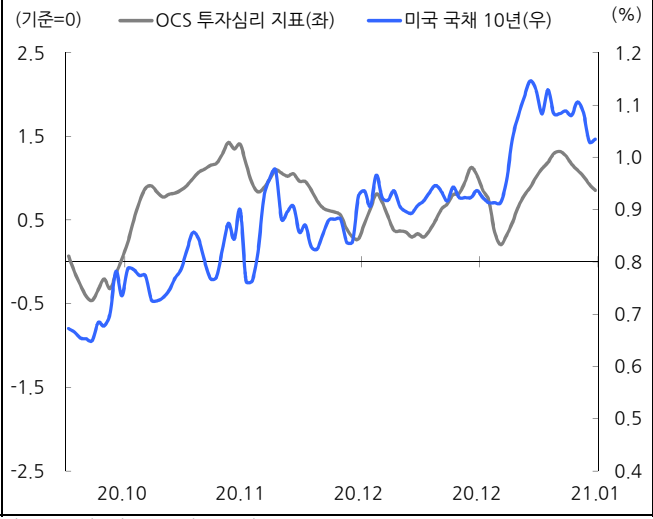
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

S&P500 vs. 자산가격 투자심리 지표



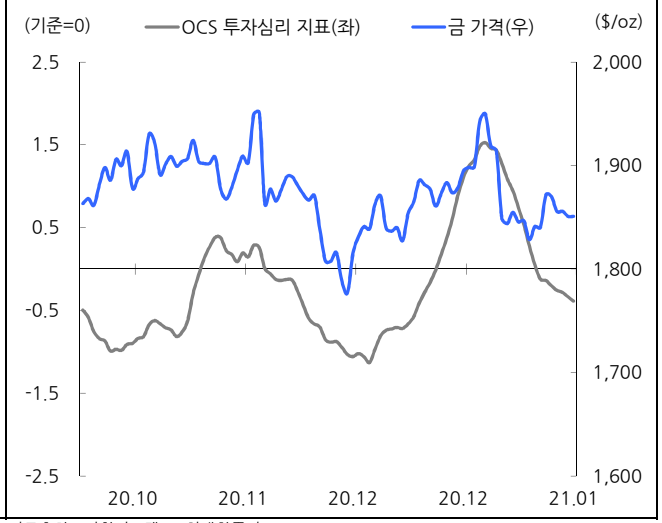
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

미국 국채 10년 vs. 자산가격 투자심리 지표



자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

금 가격 vs. 자산가격 투자심리 지표



자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

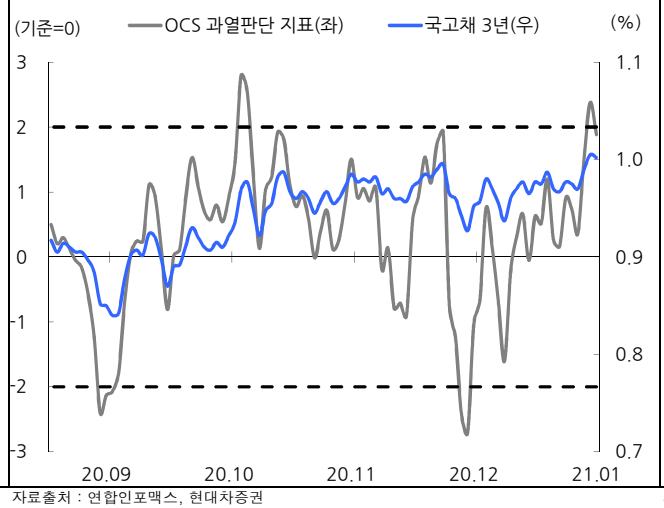
자산가격 과열판단 지표

Macro Economy Strategy 오 창 섭
2021년 1월 27일

KOSPI vs. 과열판단 투자심리 지표

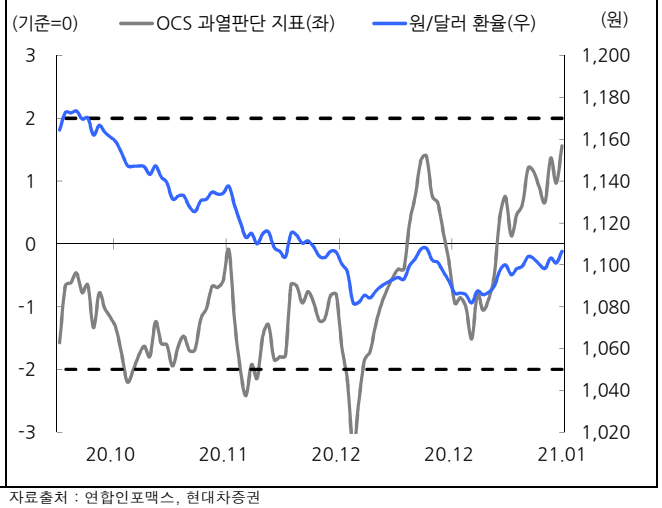
주: 과열판단 지표는 절대값 2을 기준으로 하락과열(-2 이하) 및 상승과열(+2 이상) 판별
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

국고채 3년 vs. 과열판단 투자심리 지표



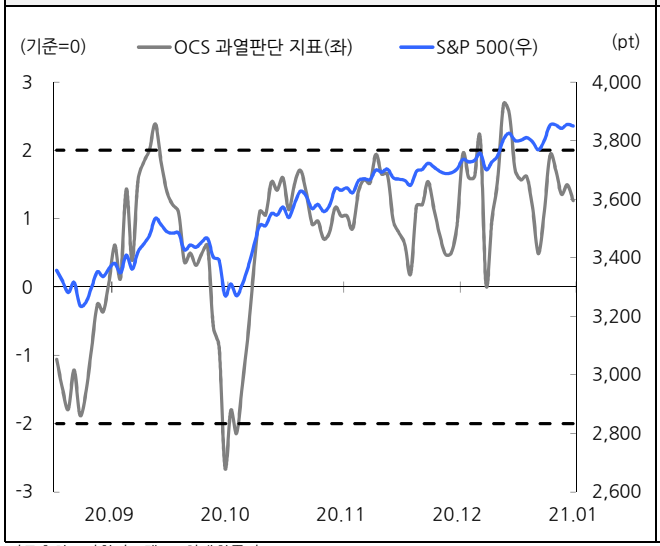
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

원/달러 환율 vs. 과열판단 투자심리 지표



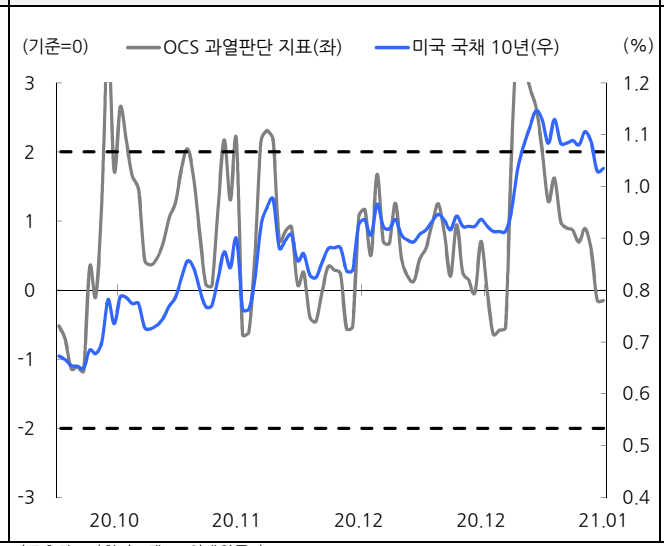
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

S&P500 vs. 과열판단 투자심리 지표



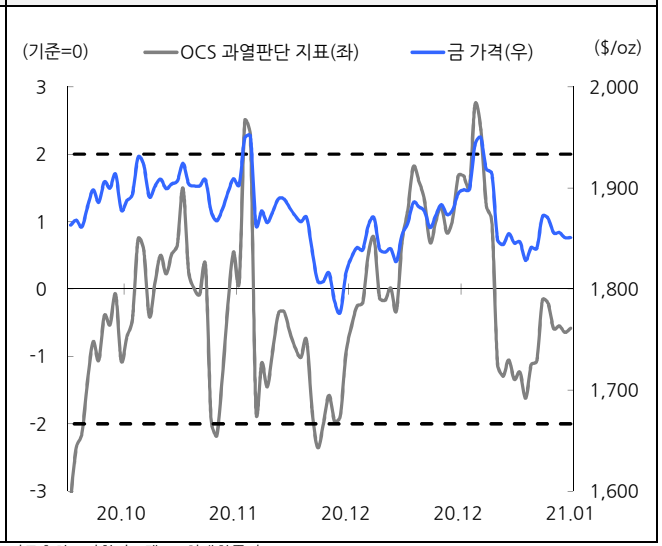
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

미국 국채 10년 vs. 과열판단 투자심리 지표



자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

금 가격 vs. 과열판단 투자심리 지표

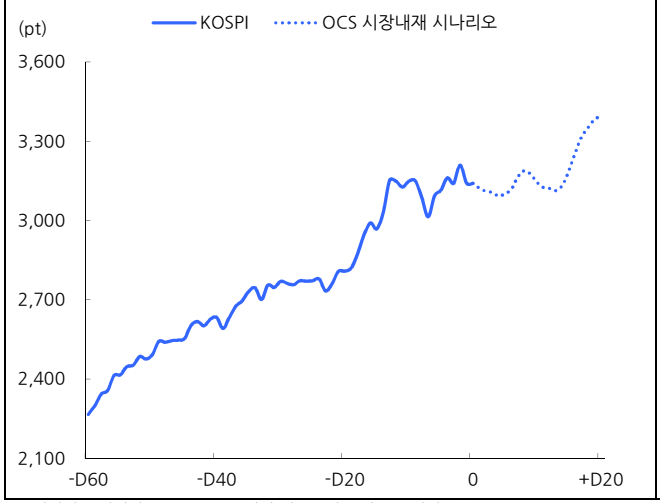


자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

시장내재 시나리오 지표

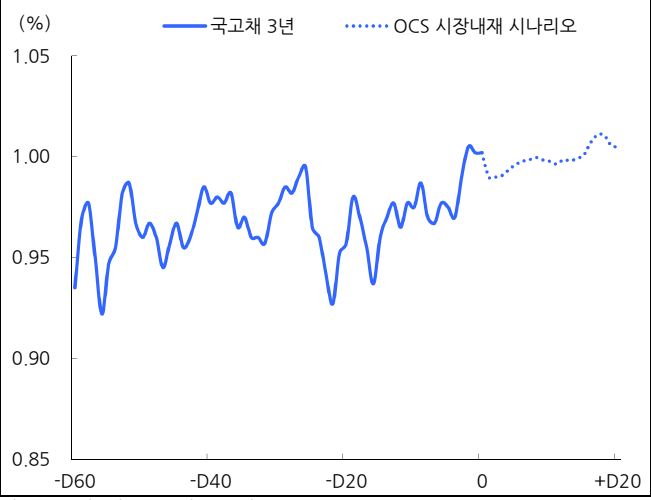
Macro Economy Strategy 오 창 섭
2021년 1월 27일

KOSPI vs. 시장내재 시나리오 지표



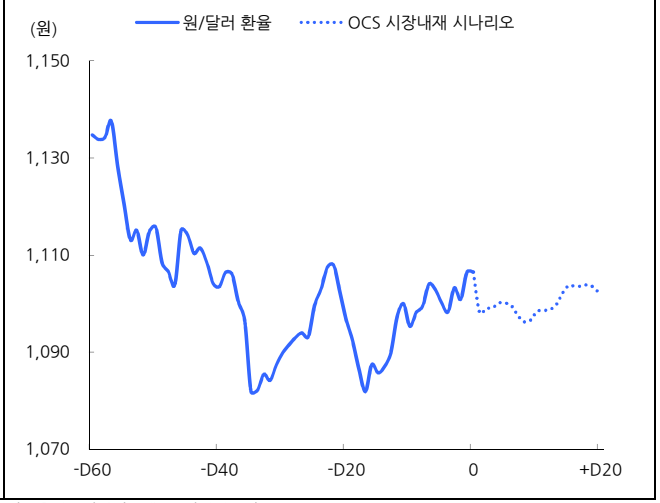
주: 시장내재 시나리오 지표는 금융시장 상관관계를 이용한 시장예측 지표
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

국고채 3년 vs. 시장내재 시나리오 지표



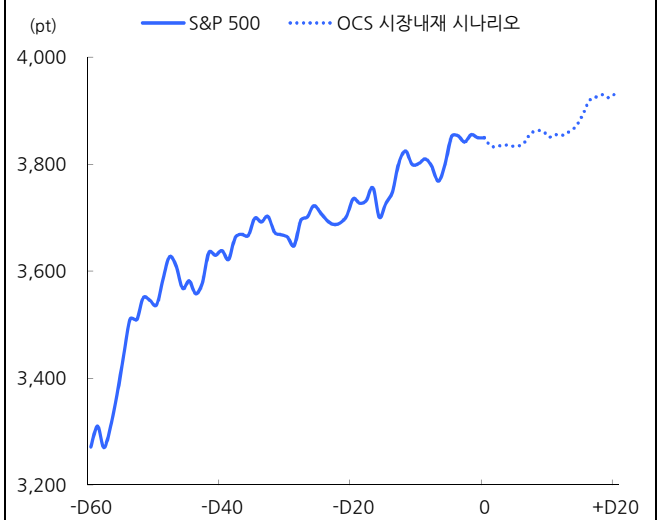
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

원/달러 환율 vs. 시장내재 시나리오 지표



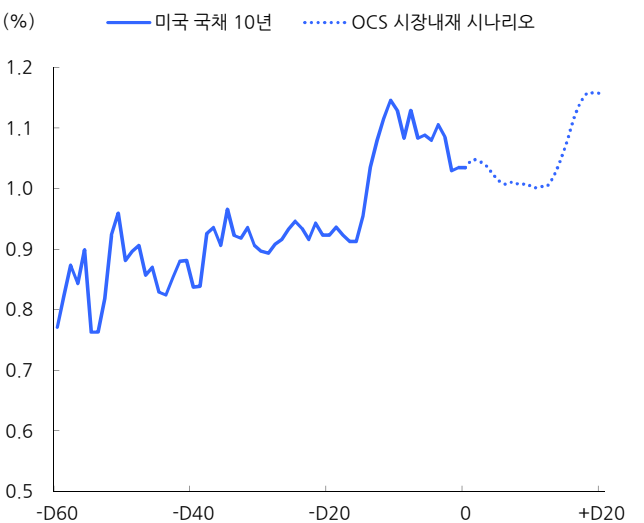
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

S&P500 vs. 시장내재 시나리오 지표



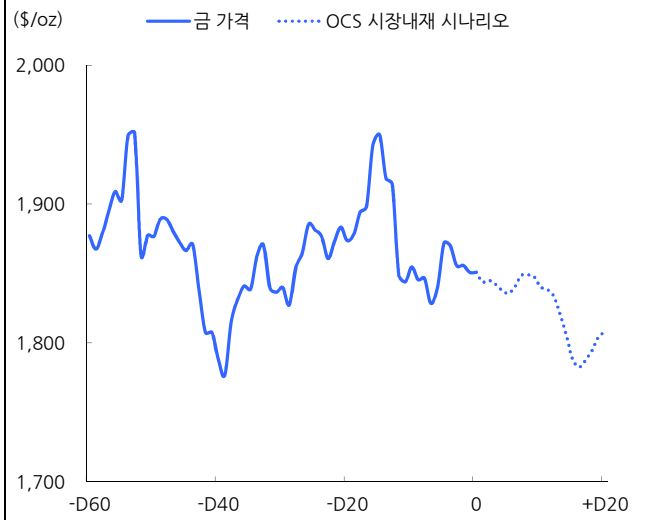
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

미국 국채 10년 vs. 시장내재 시나리오 지표



자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

금 가격 vs. 시장내재 시나리오 지표

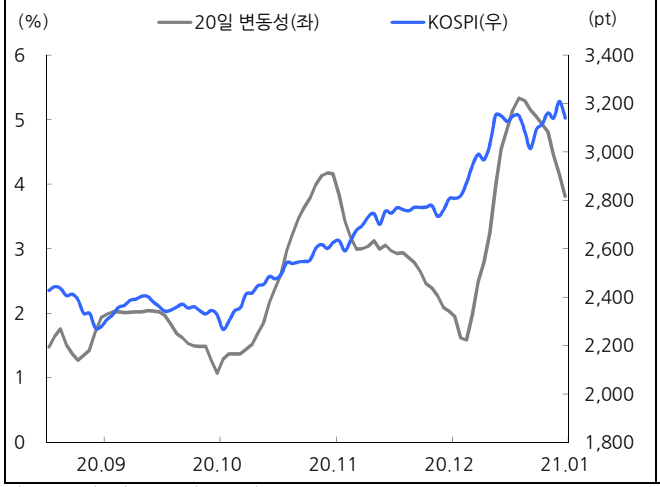


자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

자산가격 변동성 현황

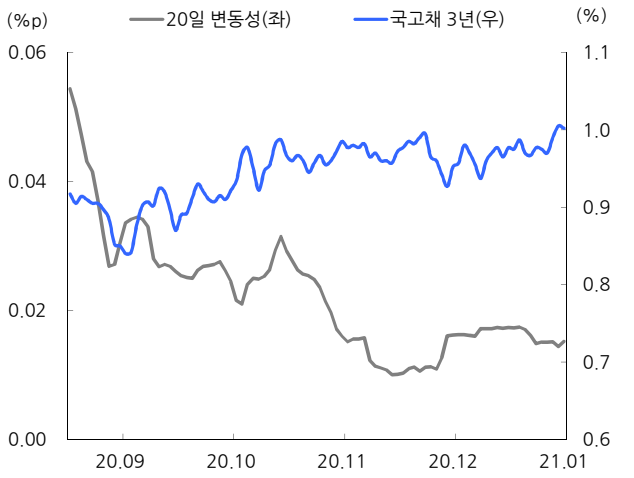
Macro Economy Strategy 오 창 섭
2021년 1월 27일

KOSPI vs. 자산가격 변동성 현황



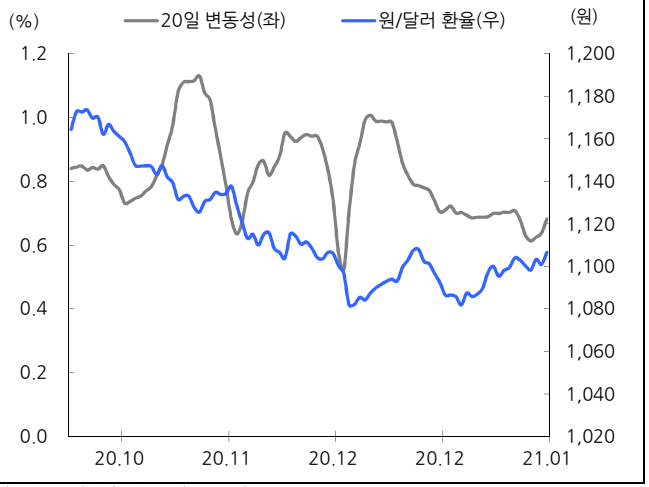
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

국고채 3년 vs. 자산가격 변동성 현황



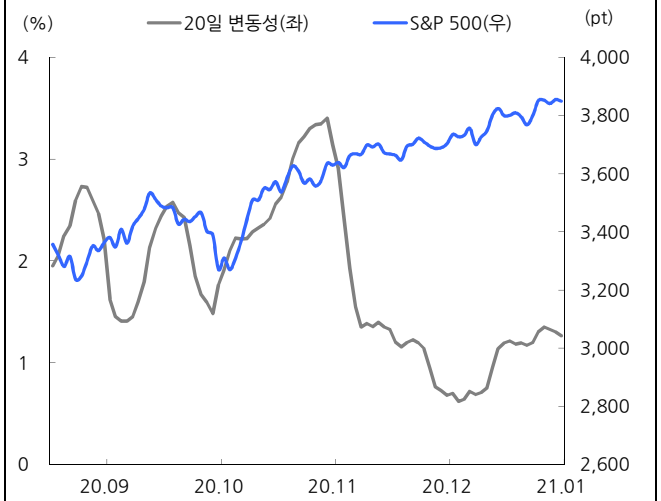
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

원/달러 환율 vs. 자산가격 변동성 현황



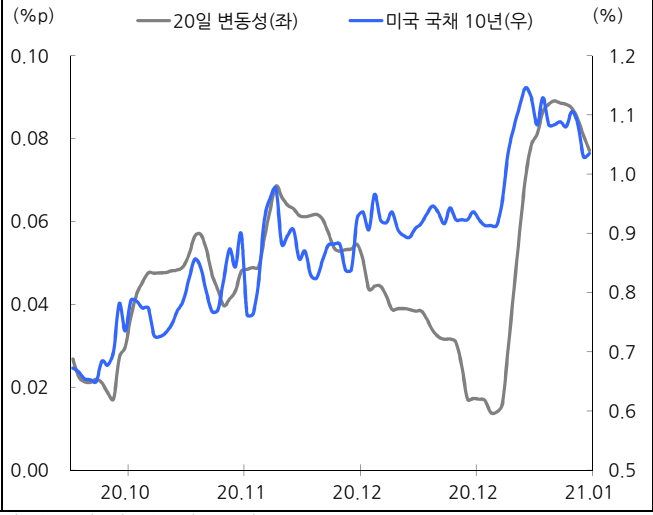
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

S&P500 vs. 자산가격 변동성 현황



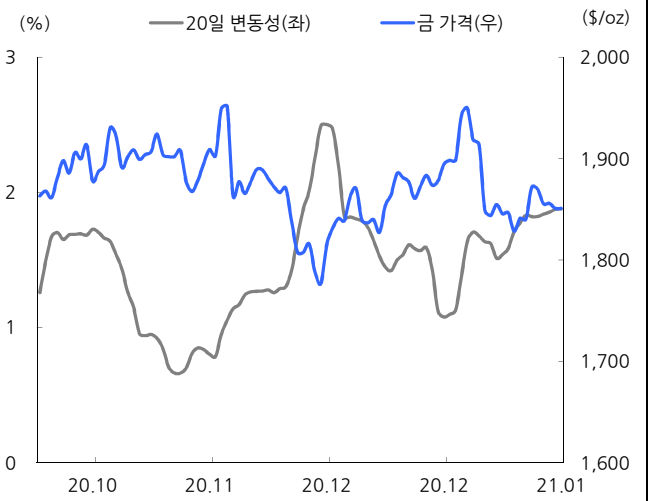
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

미국 국채 10년 vs. 자산가격 변동성 현황



자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

금 가격 vs. 자산가격 변동성 현황

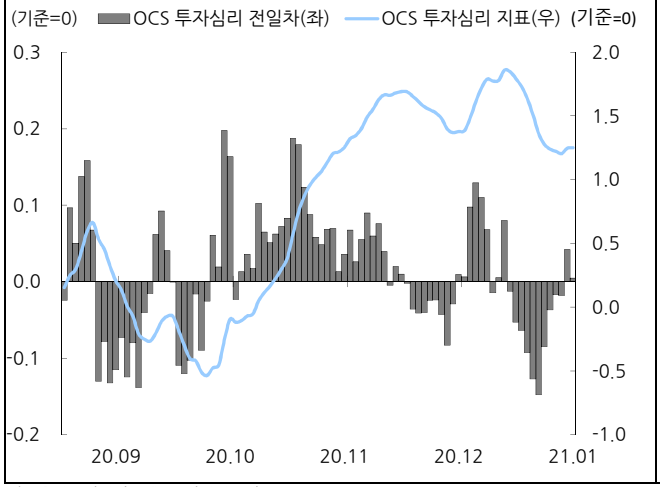


자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

자산가격 투자심리 전일차

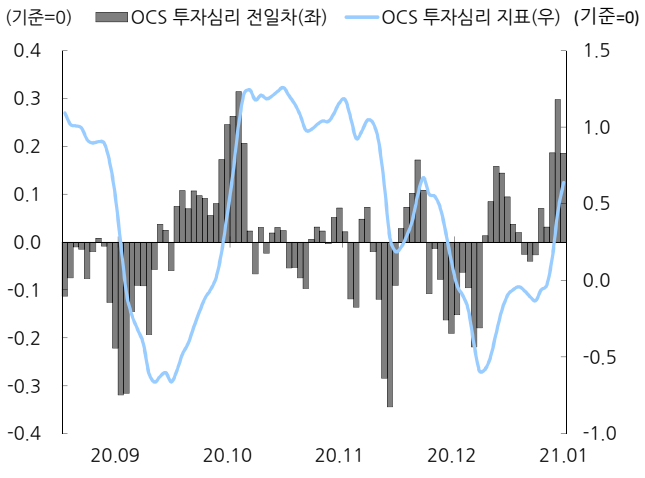
Macro Economy Strategy 오 창 섭
2021년 1월 27일

KOSPI vs. 자산가격 투자심리 전일차



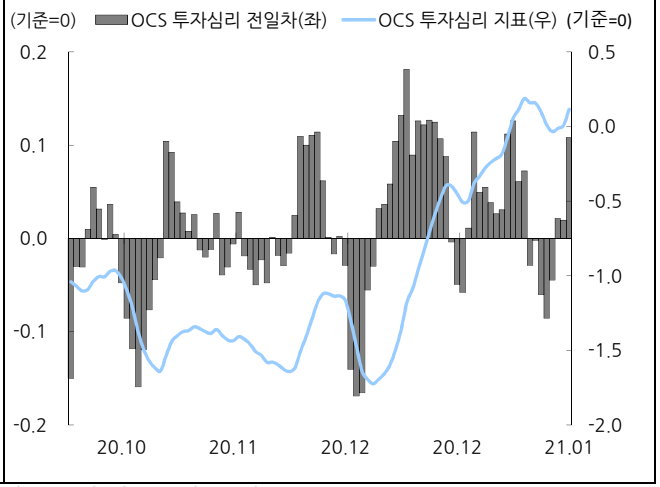
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

국고채 3년 vs. 자산가격 투자심리 전일차



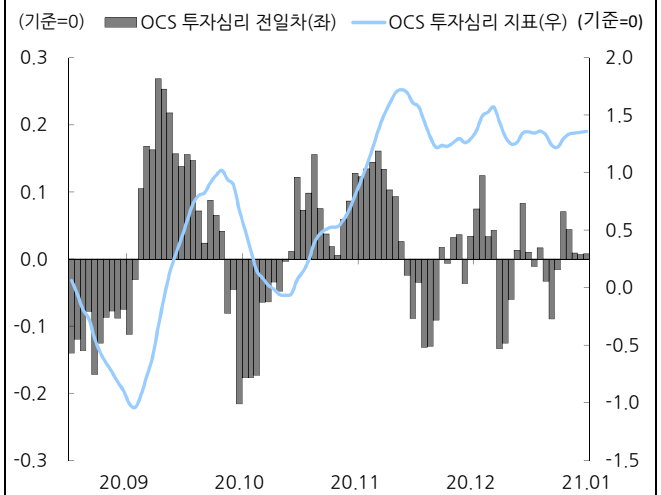
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

원/달러 환율 vs. 자산가격 투자심리 전일차



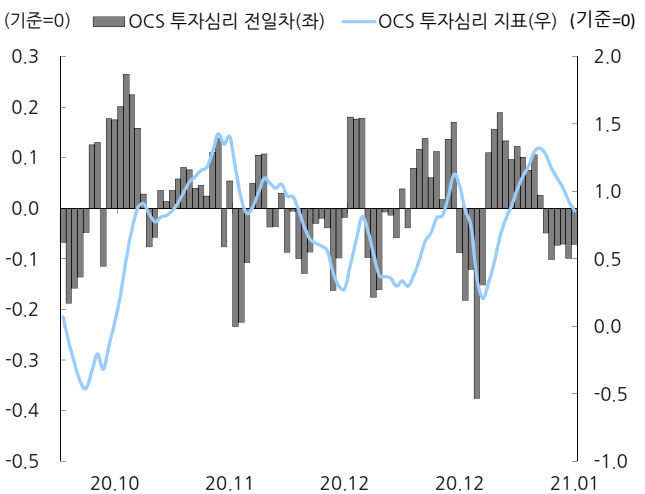
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

S&P500 vs. 자산가격 투자심리 전일차



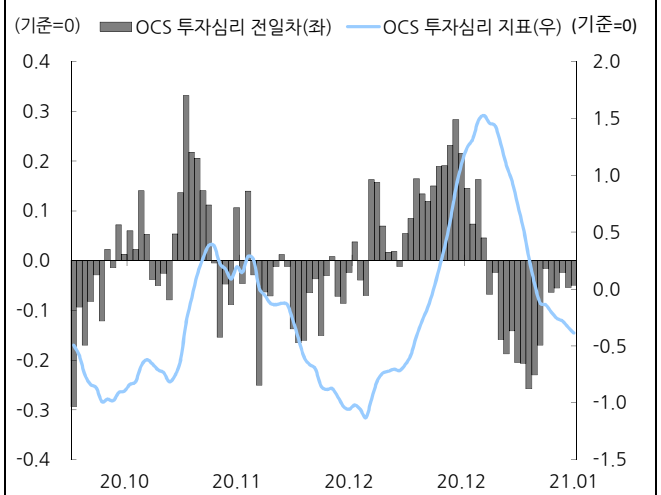
자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

미국 국채 10년 vs. 자산가격 투자심리 전일차



자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

금 가격 vs. 자산가격 투자심리 전일차



자료출처 : 연합인포맥스, 현대차증권

국내외 금융시장 동향

Macro Economy Strategy 오 창 섭

2021년 1월 27일

▪ 전세계 주요국 주가지수(Point)

한국	종가	1D(%)	MTD(%)	YTD(%)
KOSPI	3,140.31	-2.14	9.29	9.29
KOSDAQ	994.00	-0.53	2.64	2.64
지역별	**종가**	**1D(%)**	**MTD(%)**	**YTD(%)**
MSCI 세계	666.09	-0.30	3.07	3.07
MSCI 선진국	2,754.12	-0.10	2.38	2.38
MSCI 신흥국	1,388.76	-1.52	7.55	7.55
선진국	**종가**	**1D(%)**	**MTD(%)**	**YTD(%)**
미국 S&P 500	3,849.62	-0.15	2.49	2.49
미국 Dow Jones	30,937.04	-0.07	1.08	1.08
미국 NASDAQ	13,626.06	-0.07	5.72	5.72
일본 Nikkei 225	28,546.18	-0.96	4.02	4.02
홍콩 Hangseng	29,391.26	-2.55	7.93	7.93
영국 FTSE 100	6,654.01	0.23	2.99	2.99
프랑스 CAC	5,523.52	0.93	-0.50	-0.50
독일 DAX 30	13,870.99	1.66	1.11	1.11
스페인 IBEX	7,964.90	0.86	-1.35	-1.35
신흥국	**종가**	**1D(%)**	**MTD(%)**	**YTD(%)**
브라질 BOVESPA	116,464.10	-0.78	-2.15	-2.15
러시아 RTS	1,422.95	0.77	2.56	2.56
인도 SENSEX	48,347.59	0.00	1.25	1.25
중국 Shanghai Composit	3,569.43	-1.51	2.77	2.77
베트남 VN	1,136.12	-2.57	2.92	2.92
인도네시아 IDX	6,140.17	-1.89	2.69	2.69
멕시코 VOLSA	45,053.56	-0.16	2.24	2.24

▪ 전세계 주요 산업별 주가지수(Point)

지수	종가	1D(%)	MTD(%)	YTD(%)
미국 S&P 500 에너지	307.50	-2.12	7.46	7.46
미국 S&P 500 소재	459.38	-1.40	0.81	0.81
미국 S&P 500 산업재	736.48	-0.91	-1.74	-1.74
미국 S&P 500 경기소비재	1,373.12	0.06	5.42	5.42
미국 S&P 500 필수소비재	682.05	0.93	-2.05	-2.05
미국 S&P 500 의료건강	1,374.40	-0.40	3.81	3.81
미국 S&P 500 금융	496.25	-0.80	1.19	1.19
미국 S&P 500 정보기술	2,359.81	0.01	2.99	2.99
미국 S&P 500 통신	228.77	0.79	3.09	3.09
미국 S&P 500 공공산업	322.67	-0.99	1.13	1.13
미국 S&P 500 부동산	233.85	1.14	2.61	2.61
미국 Dow Jones 운송	12,643.27	-1.61	1.09	1.09
필라델피아 반도체 지수	3,031.77	-1.54	8.45	8.45
전세계 BDI 해운운임	1,765.00	0.00	29.21	29.21

▪ 원자재

상품(단위)	종가	1D(%)	MTD(%)	YTD(%)
S&P GSCI 원자재 지수(Point)	431.49	0.00	5.38	5.38
NYMEX WTI 선물(Dollar/Barrel)	52.60	-0.30	8.34	8.34
NYMEX 천연가스 선물(Dollar/백만BTU)	2.64	1.50	3.86	3.86
COMEX 금 선물(Dollar/Oz)	1,852.75	-0.23	-2.24	-2.24
COMEX 은 선물(Dollar/Oz)	25.55	0.22	-3.26	-3.26
LME 구리 선물(Dollar/Ton)	7,969.00	0.00	2.61	2.61
LME 아연 선물(Dollar/Ton)	2,705.50	0.00	-1.65	-1.65
중국 철광석 선물(100CNY/백만Ton)	1,176.10	0.90	9.24	9.24
S&P GSCI 농산물 지수(Point)	378.92	0.00	3.07	3.07
CBOT 옥수수 선물(Dollar/Bushel)	532.25	4.06	9.97	9.97
CBOT 밀 선물(Dollar/Bushel)	665.25	2.58	3.86	3.86
CBOT 대두 선물(Dollar/Bushel)	1,370.25	1.99	4.52	4.52

▪ 환율

환율(단위)	종가	1D(%)	MTD(%)	YTD(%)
미국 달러화 지수(Point)	90.18	-0.23	0.27	0.27
한국 원 / 미국 1달러(KRW)	1,106.49	0.51	1.84	1.84
미국 달러 / 영국 1파운드(USD)	1.37	0.45	0.48	0.48
미국 달러 / 유럽 1유로(USD)	1.22	0.17	-0.47	-0.47
일본 엔 / 미국 1달러(JPY)	103.62	-0.13	0.36	0.36
중국 위안 / 미국 1달러(CNY)	6.47	-0.23	-0.95	-0.95
미국 달러 / 호주 1달러(USD)	0.77	0.44	0.69	0.69
브라질 헤알 / 미국 1달러(BRL)	5.36	-2.04	3.12	3.12
인도 루피 / 미국 1달러(INR)	72.91	-0.12	-0.18	-0.18
러시아 루블 / 미국 1달러(RUB)	75.18	-0.27	1.54	1.54

▪ 자금동향

구분	잔액(십억원)	1D(십억원)	MTD(십억원)	YTD(십억원)
국내 채권펀드	120,993	96.0	3,088.0	3,088.0
국내 주식펀드	97,308	-290.0	6,589.0	6,589.0
국내 채권혼합	16,547	-26.0	339.0	339.0
국내 주식혼합	9,543	-1.0	-15.0	-15.0
국내 단기금융펀드	150,722	-319.0	24,401.0	24,401.0
국내 부동산펀드	113,734	97.0	664.0	664.0
국내 주식예탁금	68,474	637.5	2,951.7	2,951.7
외국인 국내주식 누적 순매수	-21,799	-1,922.4	-1,863.0	-1,863.0
외국인 국내채권 누적 순매수	217,676	949.5	2,452.8	2,452.8

▪ 주가변동성 지수

지수(단위)	종가	1D(%p)	MTD(%p)	YTD(%p)
미국 VIX(%/30일)	23.02	-0.17	0.27	0.27
유럽 VSTOXX(%/30일)	23.10	-2.91	-0.27	-0.27
한국 VKOSPI(%/30일)	29.99	1.02	7.90	7.90

▪ 전세계 산업별 주요기업

업종	종목(통화)	시가총액(십억USD)	종가	1D(%)	MTD(%)	YTD(%)
(에너지)	Exxon Mobil(USD)	193.9	45.87	-2.20	11.28	11.28
	Chevron(USD)	172.0	89.36	-1.69	5.81	5.81
	Royal Dutch(GBP)	146.2	1,393.40	0.90	7.37	7.37
	Petrochina(HKD)	110.7	2.41	-1.63	0.42	0.42
(소재)	BHP Billiton(AUD)	167.5	46.62	0.00	9.88	9.88
	Basf(EUR)	72.7	65.08	0.03	0.56	0.56
(산업재)	Siemens(EUR)	135.1	130.66	1.79	11.18	11.18
	Boeing(USD)	114.1	202.06	-0.64	-5.61	-5.61
	3M(USD)	101.5	175.95	3.26	0.66	0.66
	GE(USD)	98.9	11.29	2.73	4.54	4.54
(경기소비재)	Amazon(USD)	1,668.9	3,326.13	0.98	2.12	2.12
	Tesla Motors(USD)	837.1	883.09	0.26	25.14	25.14
	LVMH(EUR)	311.9	508.00	1.22	-0.57	-0.57
	Walt Disney(USD)	307.6	169.56	-1.36	-6.41	-6.41
	Toyota(JPY)	236.1	7,500.00	-2.31	-5.74	-5.74
	Daimler(EUR)	76.6	58.89	2.52	1.90	1.90
(필수소비재)	Wal-Mart(USD)	417.3	147.51	0.90	2.33	2.33
	Nestle(CHF)	335.8	103.36	1.53	-0.86	-0.86
	P&G(USD)	327.7	133.09	0.64	-4.35	-4.35
	Cocacola(USD)	211.8	49.29	1.05	-10.12	-10.12
	ABI(EUR)	130.5	53.12	-0.09	-6.82	-6.82
	Philip Morris(USD)	127.7	81.99	0.80	-0.97	-0.97
(의료건강)	J&J(USD)	448.8	170.48	2.71	8.32	8.32
	Roche(CHF)	315.3	322.95	0.67	4.51	4.51
	Pfizer(USD)	207.4	37.31	0.08	1.36	1.36
	Gilead Sciences(USD)	83.6	66.70	-2.14	14.49	14.49
(금융)	JPMorgan Chase(USD)	401.1	131.58	-0.41	3.55	3.55
	ICBC(CNY)	266.1	5.03	-0.40	0.80	0.80
	Goldman Sachs(USD)	101.1	281.76	-0.45	6.84	6.84
	Banco Santander(EUR)	53.4	2.53	1.71	-0.22	-0.22
(정보기술)	Apple(USD)	2,408.4	143.16	0.17	7.89	7.89
	Microsoft(USD)	1,752.3	232.33	1.22	4.46	4.46
	Google(USD)	1,293.9	1,917.24	0.94	9.44	9.44
	Facebook(USD)	803.4	282.05	1.45	3.25	3.25
	Alibaba(USD)	719.5	265.92	1.74	14.26	14.26
	Samsung Electronics(1만KRW)	469.6	8.67	-3.02	7.04	7.04
	Nvidia(USD)	332.7	537.41	-1.60	2.91	2.91
	Intel(USD)	224.3	55.21	-0.41	10.82	10.82
(통신)	AT&T(USD)	212.0	29.75	2.20	3.44	3.44
	China Mobile(HKD)	120.2	45.50	-3.50	2.94	2.94

국내외 채권금리 동향

Macro Economy Strategy 오 창 섭

2021년 1월 27일

■ 국내 금융투자협회 최종호가 수익률

무위험채권 수익률	종가(%)	1D(%p)	MTD(%p)	YTD(%p)
통안증권 91일	0.52	-0.00	-0.15	-0.15
통안증권 1년	0.70	0.00	-0.05	-0.05
통안증권 2년	0.91	0.00	-0.01	-0.01
국고 3년	1.01	0.00	0.03	0.03
국고 5년	1.35	-0.00	0.01	0.01
국고 10년	1.77	-0.01	0.06	0.06
국고 20년	1.90	0.01	0.08	0.08
국고 30년	1.90	0.01	0.08	0.08
신용채권 수익률	**종가(%)**	**1D(%p)**	**MTD(%p)**	**YTD(%p)**
CD 91일	0.69	0.00	0.03	0.03
CP 91일	1.02	0.00	-0.07	-0.07
산금채 1년	0.84	0.01	-0.05	-0.05
한전채 3년	1.21	-0.01	-0.32	-0.32
국민주택 5년	1.48	-0.00	-0.01	-0.01
회사채 AA- 3년	2.12	-0.00	-0.09	-0.09
회사채 BBB- 3년	8.51	-0.00	-0.11	-0.11

■ 전세계 주요국 기준금리

선진국	종가(%)	MTD(%p)	QTD(%p)	YTD(%p)
미국	0.25	0.00	0.00	0.00
유로	0.00	0.00	0.00	0.00
영국	0.10	0.00	0.00	0.00
캐나다	0.25	0.00	0.00	0.00
일본	-0.10	0.00	0.00	0.00
대만	1.13	0.00	0.00	0.00
호주	0.10	0.00	0.00	0.00
신흥국	**종가(%)**	**MTD(%p)**	**QTD(%p)**	**YTD(%p)**
중국	4.35	0.00	0.00	0.00
브라질	2.00	0.00	0.00	0.00
인도	4.00	0.00	0.00	0.00
한국	0.50	0.00	0.00	0.00
러시아	4.25	0.00	0.00	0.00
멕시코	4.25	0.00	0.00	0.00
인도네시아	3.75	0.00	0.00	0.00

■ 신흥국 CDS Premium

단위	종가(bp)	1D(bp)	MTD(bp)	YTD(bp)
브라질 국채 5년	177.16	-0.70	34.31	34.31
러시아 국채 5년	95.49	-3.43	9.53	9.53
중국 국채 5년	30.49	-0.08	2.53	2.53
한국 국채 5년	23.95	-0.05	2.04	2.04
EMBI+ Spread	352.41	2.42	13.97	13.97

■ 은행간 단기 대출금리

만기 1개월	종가(%)	1D(%p)	MTD(%p)	YTD(%p)
영국-LIBOR(미국달러)	0.12	-0.01	-0.02	-0.02
한국-KORIBOR(원화)	0.57	0.00	-0.03	-0.03
중국-SHIBOR(위안화)	2.55	0.04	-0.16	-0.16
만기 3개월	**종가(%)**	**1D(%p)**	**MTD(%p)**	**YTD(%p)**
영국-LIBOR(미국달러)	0.22	0.01	-0.02	-0.02
한국-KORIBOR(원화)	0.75	0.01	-0.06	-0.06
중국-SHIBOR(위안화)	2.59	0.01	-0.17	-0.17
만기 6개월	**종가(%)**	**1D(%p)**	**MTD(%p)**	**YTD(%p)**
영국-LIBOR(미국달러)	0.23	0.00	-0.02	-0.02
한국-KORIBOR(원화)	0.81	0.00	-0.09	-0.09
중국-SHIBOR(위안화)	2.70	0.01	-0.14	-0.14
만기 12개월	**종가(%)**	**1D(%p)**	**MTD(%p)**	**YTD(%p)**
영국-LIBOR(미국달러)	0.31	-0.00	-0.03	-0.03
한국-KORIBOR(원화)	0.88	0.01	-0.06	-0.06
중국-SHIBOR(위안화)	2.91	0.01	-0.09	-0.09

■ 국내 투자자별 장외시장 채권잔고

구분	종가(조원)	1D(십억원)	MTD(십억원)	YTD(십억원)
보험사	502.5	691.4	6,840.8	6,840.8
연기금	292.0	-159.2	3,883.1	3,883.1
은행	352.8	-117.5	698.9	698.9
자산운용사	215.7	345.6	11,062.6	11,062.6
외국인	148.2	176.7	514.7	514.7
일반회사	64.2	70.6	1,228.0	1,228.0
증권사	47.7	54.4	-995.7	-995.7

■ 국내 투자자별 3년 국채선물 누적순매수

구분	종가(계약)	1D(계약)	MTD(계약)	YTD(계약)
외국인	21,772	-5,158	-26,919	-26,919
은행	-35,961	886	-9,675	-9,675
증권사	93,429	4,640	49,399	49,399
보험사	-5,203	2	-1,363	-1,363
연기금	-16,826	440	1,240	1,240
개인	-30,891	43	-13,267	-13,267

■ 국내 투자자별 10년 국채선물 누적순매수

구분	종가(계약)	1D(계약)	MTD(계약)	YTD(계약)
외국인	38,016	3,646	-829	-829
은행	-11,372	586	-2,431	-2,431
증권사	-32,230	-3,855	2,180	2,180
보험사	1,800	10	322	322
연기금	-916	-69	2,388	2,388
개인	1,002	-26	-3,115	-3,115

■ 주요국 국채금리 만기구조

한국	만기 1년	만기 2년	만기 3년	만기 5년	만기 10년	만기 30년
종가(%)	0.66	0.90	1.00	1.35	1.77	1.91
1D(%p)	0.00	-0.00	-0.00	-0.01	-0.01	0.01
MTD(%p)	0.00	0.02	0.03	0.01	0.04	0.07
YTD(%p)	0.00	0.02	0.03	0.01	0.04	0.07
미국	**만기 1년**	**만기 2년**	**만기 3년**	**만기 5년**	**만기 10년**	**만기 30년**
종가(%)	0.10	0.12	0.18	0.41	1.04	1.79
1D(%p)	0.01	-0.00	0.00	0.00	0.01	-0.00
MTD(%p)	0.00	0.00	0.01	0.05	0.12	0.14
YTD(%p)	0.00	0.00	0.01	0.05	0.12	0.14
독일	**만기 1년**	**만기 2년**	**만기 3년**	**만기 5년**	**만기 10년**	**만기 30년**
종가(%)	-0.61	-0.72	-0.76	-0.73	-0.53	-0.12
1D(%p)	0.02	0.01	0.01	0.01	0.02	0.02
MTD(%p)	0.08	-0.01	0.00	0.00	0.04	0.04
YTD(%p)	0.08	-0.01	0.00	0.00	0.04	0.04
일본	**만기 1년**	**만기 2년**	**만기 3년**	**만기 5년**	**만기 10년**	**만기 30년**
종가(%)	-0.13	-0.13	-0.13	-0.11	0.04	0.65
1D(%p)	0.00	0.00	0.00	0.00	-0.00	-0.01
MTD(%p)	-0.01	-0.02	0.01	-0.01	0.01	0.00
YTD(%p)	-0.01	-0.02	0.01	-0.01	0.01	0.00
영국	**만기 1년**	**만기 2년**	**만기 3년**	**만기 5년**	**만기 10년**	**만기 30년**
종가(%)	-0.13	-0.14	-0.11	-0.06	0.27	0.84
1D(%p)	-0.02	-0.01	-0.00	0.00	0.00	0.00
MTD(%p)	0.01	0.01	0.00	0.03	0.07	0.09
YTD(%p)	0.01	0.01	0.00	0.03	0.07	0.09
중국	**만기 1년**	**만기 2년**	**만기 3년**	**만기 5년**	**만기 10년**	**만기 30년**
종가(%)	2.61	2.75	2.85	3.00	3.19	3.75
1D(%p)	0.08	0.09	0.06	0.04	0.04	0.01
MTD(%p)	-0.09	0.00	0.05	0.05	-0.00	0.00
YTD(%p)	-0.09	0.00	0.05	0.05	-0.00	0.00

■ 금리 파생상품

Bond-IRS	만기 1년	만기 2년	만기 3년	만기 5년	만기 7년	만기 10년
종가(%)	-0.13	-0.00	-0.01	0.17	0.51	0.55
1D(%p)	0.00	0.00	0.00	0.00	-0.01	0.01
MTD(%p)	-0.05	-0.03	-0.03	-0.05	-0.03	-0.01
YTD(%p)	-0.05	-0.03	-0.03	-0.05	-0.03	-0.01
Bond-CRS	**만기 1년**	**만기 2년**	**만기 3년**	**만기 5년**	**만기 7년**	**만기 10년**
종가(%)	0.52	0.74	0.81	1.04	1.30	1.25
1D(%p)	0.03	0.03	0.03	0.01	0.00	0.02
MTD(%p)	0.11	0.15	0.15	0.10	0.13	0.13
YTD(%p)	0.11	0.15	0.15	0.10	0.13	0.13

국내 금융시장 종합

Macro Economy Strategy 오 창 섭

2021년 1월 27일

▪ 국내 시가평가 채권수익률

특수채 AAA	종가(%)	1D(%p)	MTD(%p)	YTD(%p)
만기 1년 신용금리차	0.22	0.01	-0.02	-0.02
만기 2년 신용금리차	0.16	0.00	-0.04	-0.04
만기 3년 신용금리차	0.15	0.00	-0.02	-0.02
만기 5년 신용금리차	0.14	0.00	-0.02	-0.02
만기 10년 신용금리차	0.14	0.00	-0.00	-0.00
은행채 AAA	**종가(%)**	**1D(%p)**	**MTD(%p)**	**YTD(%p)**
만기 1년 신용금리차	0.24	0.01	-0.05	-0.05
만기 2년 신용금리차	0.15	0.00	-0.04	-0.04
만기 3년 신용금리차	0.17	-0.00	-0.02	-0.02
만기 5년 신용금리차	0.20	0.00	-0.01	-0.01
카드채 AA+	**종가(%)**	**1D(%p)**	**MTD(%p)**	**YTD(%p)**
만기 1년 신용금리차	0.31	0.00	-0.06	-0.06
만기 2년 신용금리차	0.27	0.00	-0.07	-0.07
만기 3년 신용금리차	0.27	-0.00	-0.05	-0.05
만기 5년 신용금리차	0.29	-0.01	-0.06	-0.06
회사채 AA0	**종가(%)**	**1D(%p)**	**MTD(%p)**	**YTD(%p)**
만기 1년 신용금리차	0.34	0.00	-0.06	-0.06
만기 2년 신용금리차	0.26	-0.01	-0.08	-0.08
만기 3년 신용금리차	0.28	-0.00	-0.08	-0.08
만기 5년 신용금리차	0.32	-0.00	-0.06	-0.06
회사채 A+	**종가(%)**	**1D(%p)**	**MTD(%p)**	**YTD(%p)**
만기 1년 신용금리차	0.78	0.00	-0.06	-0.06
만기 2년 신용금리차	0.61	-0.01	-0.08	-0.08
만기 3년 신용금리차	0.67	-0.00	-0.07	-0.07
만기 5년 신용금리차	0.92	-0.00	-0.05	-0.05
회사채 A0	**종가(%)**	**1D(%p)**	**MTD(%p)**	**YTD(%p)**
만기 1년 신용금리차	0.95	-0.00	-0.06	-0.06
만기 2년 신용금리차	0.81	-0.01	-0.08	-0.08
만기 3년 신용금리차	0.95	-0.00	-0.07	-0.07
만기 5년 신용금리차	1.34	-0.00	-0.05	-0.05

▪ 주요통화 대비 한국원화 환율

환율	종가(%)	1D(%)	MTD(%)	YTD(%)
한국 원 / 유럽 1유로	1,339.62	0.15	0.10	0.10
한국 원 / 영국 1파운드	1,508.79	-0.06	1.78	1.78
한국 원 / 일본 100엔	1,063.27	0.11	0.85	0.85
한국 원 / 중국 1위안	170.92	0.29	3.03	3.03
한국 원 / 호주 1달러	850.95	-0.32	1.72	1.72
한국 원 / 브라질 1헤알	201.79	-1.77	-3.67	-3.67
한국 원 / 러시아 1루블	14.65	-1.41	0.21	0.21
한국 원 / 인도 1루피	15.12	0.33	1.75	1.75

▪ 국내 주식시장 주요산업 지수

KOSPI	시가총액(조원)	종가(Point)	1D(%)	MTD(%)	YTD(%)
전기전자	494.75	32,752.69	-0.10	9.95	9.95
금융지주	221.67	415.01	-0.45	5.73	5.73
화학	150.19	7,499.06	0.60	15.31	15.31
운수장비	106.84	2,485.47	-0.85	29.16	29.16
의약품	76.21	19,877.35	2.20	-5.73	-5.73
유통	65.48	414.93	-1.44	5.13	5.13
보험	44.32	12,375.82	-0.58	-2.25	-2.25
철강/금속	41.86	4,116.30	-1.41	0.10	0.10
통신	33.25	342.38	0.64	5.30	5.30
음식료	23.74	4,226.01	1.60	7.26	7.26
전기가스	23.58	785.37	0.63	-7.04	-7.04
운수창고	22.68	1,987.46	2.73	13.18	13.18
증권	22.43	1,987.11	-0.19	4.37	4.37
건설	20.63	116.13	-2.40	9.35	9.35
기계	20.24	1,035.23	-0.66	6.50	6.50
비금속광물	10.52	2,451.68	-1.43	18.37	18.37
은행	7.29	174.27	-2.48	-5.86	-5.86
KOSDAQ	**시가총액(조원)**	**종가(Point)**	**1D(%)**	**MTD(%)**	**YTD(%)**
제약	27.41	13,003.34	1.83	-7.39	-7.39
반도체	24.93	1,855.51	2.68	8.53	8.53
IT부품	16.11	1,049.18	0.84	7.88	7.88
기계장비	12.52	720.73	0.84	8.85	8.85
화학	11.04	3,319.92	2.15	6.29	6.29
디지털컨텐츠	9.56	1,286.84	2.08	8.85	8.85
소프트웨어	9.17	307.52	-0.15	1.80	1.80
운송장비부품	9.06	7,755.85	-0.36	9.03	9.03
의료정밀	7.91	1,627.17	0.00	0.80	0.80
통신장비	7.87	271.61	0.41	1.45	1.45
방송서비스	5.26	4,873.53	1.56	11.93	11.93
금속	4.87	1,924.31	-0.38	1.86	1.86
음식료담배	4.70	10,135.57	0.82	3.65	3.65
기타 산업분류 지수	**시가총액(조원)**	**종가(Point)**	**1D(%)**	**MTD(%)**	**YTD(%)**
KOSPI 200 필수소비재	-	1,202.36	1.18	3.46	3.46
KOSPI 200 경기소비재	-	2,021.30	-1.31	22.42	22.42
KOSPI 200 산업재	-	591.17	2.48	14.24	14.24
KOSDAQ 150 경기소비재	-	1,095.24	0.06	6.85	6.85
KOSDAQ 150 필수소비재	-	645.91	2.01	-2.30	-2.30
KOSDAQ 150 산업재	-	286.57	-0.20	9.44	9.44
KRX 경기소비재	-	1,439.56	-1.81	11.27	11.27
KRX 필수소비재	-	1,774.32	1.40	5.28	5.28

▪ 국내 산업별 주요기업

업종	종목	시가총액(조원)	종가(원)	1D(%)	MTD(%)	YTD(%)
(전기/전자)	삼성전자(KOSPI)	328.3	86,700	-0.12	7.04	7.04
	SK하이닉스(KOSPI)	68.3	129,000	0.39	8.86	8.86
	삼성SDI(KOSPI)	15.5	790,000	-0.25	25.80	25.80
	LG전자(KOSPI)	11.8	170,000	-4.23	25.93	25.93
	LG디스플레이(KOSPI)	5.6	24,100	2.34	29.92	29.92
(화학)	LG화학(KOSPI)	22.1	955,000	-2.05	15.90	15.90
	LG생활건강(KOSPI)	19.7	1,626,000	4.10	0.37	0.37
	아모레퍼시픽(KOSPI)	11.6	238,000	0.00	15.53	15.53
	S-Oil(KOSPI)	10.9	70,700	-3.15	2.17	2.17
	롯데케미칼(KOSPI)	8.0	282,000	-2.42	2.17	2.17
(금융)	신한지주(KOSPI)	21.6	32,350	-1.52	0.94	0.94
	KB금융(KOSPI)	20.7	43,000	-2.38	-0.92	-0.92
	하나금융지주(KOSPI)	11.5	35,300	-2.89	2.32	2.32
	한국금융지주(KOSPI)	4.1	86,900	0.12	10.00	10.00
(운수/장비)	현대차(KOSPI)	26.1	251,500	-2.14	30.99	30.99
	현대모비스(KOSPI)	24.5	338,000	-3.43	32.29	32.29
	기아차(KOSPI)	18.1	89,700	2.16	43.75	43.75
	현대중공업(KOSPI)	8.9	106,000	0.95	-2.30	-2.30
(유통)	삼성물산(KOSPI)	20.5	141,500	-3.08	2.54	2.54
	셀트리온헬스케어(KOSDAQ)	7.9	152,400	5.39	-6.50	-6.50
	롯데쇼핑(KOSPI)	3.9	114,500	-1.29	11.71	11.71
	이마트(KOSPI)	3.6	174,500	0.29	15.18	15.18
(서비스업)	NAVER(KOSPI)	30.0	342,000	-0.44	16.92	16.92
	삼성에스디에스(KOSPI)	15.1	202,500	0.25	13.45	13.45
	넷마블게임즈(KOSPI)	7.9	127,500	0.39	-3.04	-3.04
(제약)	삼성바이오로직스(KOSPI)	27.6	802,000	1.01	-2.91	-2.91
	셀트리온(KOSPI)	23.7	322,500	4.03	-10.17	-10.17
	한미약품(KOSPI)	3.5	378,000	4.42	3.14	3.14
(보험)	삼성생명(KOSPI)	15.3	76,600	-0.78	-3.16	-3.16
	삼성화재(KOSPI)	11.8	176,500	-1.94	-5.87	-5.87
	한화생명(KOSPI)	2.0	2,895	-0.34	18.65	18.65
(철강/금속)	POSCO(KOSPI)	20.9	257,500	-1.34	-5.33	-5.33
	고려아연(KOSPI)	8.1	413,500	-3.16	2.99	2.99
	현대제철(KOSPI)	4.3	43,650	-2.35	10.23	10.23
(통신)	SK텔레콤(KOSPI)	19.6	254,000	0.00	6.72	6.72
	KT(KOSPI)	7.1	24,150	1.90	0.63	0.63
	LG유플러스(KOSPI)	6.3	12,350	1.65	5.11	5.11
(음식료)	오리온(KOSPI)	4.3	123,000	1.23	-0.81	-0.81
	CJ제일제당(KOSPI)	3.6	461,000	3.95	21.00	21.00
	오뚜기(KOSPI)	2.0	574,000	0.88	-0.52	-0.52

1월 국내외 경제일정

Macro Economy Strategy 오 창 섭

2021년 1월 27일

일요일	월요일	화요일	수요일	목요일	금요일	토요일
12/27	12/28	12/29	12/30	12/31	1/1	1/2
	(일본) 11월 산업생산	(한국) 12월 소비자심리지수 (미국) 12월 CB 소비자기대지수	(한국) 납회일(폐장일) (한국) 11월 산업생산 (미국) FOMC 의사록 공개 (미국) 11월 도매재고 (미국) 11월 소매재고	(휴장) 연말 휴장일	(휴장) 신정 (한국) 12월 수출입동향 (한국) 12월 무역수지 (영국) 브렉시트 시행	
3	4	5	6	7	8	9
	(회의) OPEC 회의 (한국) 12월 제조업 PMI (일본) 12월 제조업 PMI (중국) 12월 차이신 제조업 PMI (독일) 12월 제조업 PMI (유럽) 12월 제조업 PMI (미국) 12월 ISM 제조업 지수 (미국) 11월 건설지출 (한국) 국고채30년물 3.15조원 입찰	(선거) 미국 조지아주 상원 결선 (미국) 12월 ISM 제조업 PMI	(공개) FOMC 의사록 (중국) 12월 차이신 서비스업 PMI (독일) 12월 서비스업 PMI (독일) 12월 소비자물가지수 (유럽) 12월 서비스업 PMI (미국) 12월 서비스업 PMI (미국) 12월 ADP 취업자 변동 (미국) 11월 내구재주문	(독일) 12월 건설업 PMI (독일) 11월 공장수주 (영국) 12월 건설업 PMI (유럽) 12월 소비자기대지수 (유럽) 12월 소비자물가지수(잠정) (유럽) 11월 소매판매 (미국) 11월 무역수지	(일본) 11월 선행지수(잠정) (독일) 11월 무역수지 (독일) 11월 산업생산 (유럽) 11월 실업률 (미국) 12월 고용보고서 (미국) 12월 ISM 서비스업 PMI (미국) 11월 도매재고 (미국) 11월 소비자신용지수	
10	11	12	13	14	15	16
	(유럽) 1월 센틱스 투자기대지수 (한국) 국고채3년물 3.25조원 입찰	(공개) EIA 단기 에너지 전망 보고서 (일본) 11월 무역수지	(공개) 베이지북 공개 (유럽) 11월 산업생산 (미국) 12월 소비자물가지수	(공개) OPEC 원유시장 보고서 (공개) OECD 경기선행지수 (발언) 파월 연준 의장 (일본) 11월 핵심기계수주 (미국) 12월 수출입 물가지수	(회의) 한국은행, 금통위 (영국) 11월 산업생산 (영국) 11월 무역수지 (영국) 11월 무역수지 (유럽) 11월 무역수지 (미국) 1월 미시간대 소비자신뢰지수 (미국) 12월 소매판매 (미국) 12월 산업생산 (미국) 12월 생산자물가지수	
17	18	19	20	21	22	23
	(휴장) 미국 마틴루터킹 주니어 추모일 (일본) 11월 산업생산 (일본) 11월 설비가동률 (한국) 국고채10년물 2.9조원 입찰	(회의) EU 경제장관급 회의 (독일) 1월 ZEW 서베이 예상 (독일) 12월 소비자물가지수 (유럽) 1월 ZEW 서베이 예상 (유럽) 11월 경상수지 (유럽) 11월 건설생산	(정치) 바이든 대통령 취임식 (독일) 12월 생산자물가지수 (유럽) 12월 소비자물가지수	(회의) ECB, BOK, BOJ 통화정책회의 (발언) ECB 리가르드 총재 (한국) 1월 수출입동향(~20일) (일본) 12월 수출입동향 (미국) 1월 필라델피아 연준 경기 전망 (미국) 12월 주택착공건수	(일본) 12월 소비자물가지수 (독일) 1월 제조업 PMI(잠정) (영국) 12월 소매판매 (유럽) 1월 제조업 PMI(잠정) (유럽) 1월 소비자기대지수 (미국) 1월 제조업 PMI(잠정) (미국) 1월 서비스업 PMI(잠정) (미국) 12월 기존주택매매	
24	25	26	27	28	21/1/29	21/1/30
	(회의) EU 외교장관급 회의 (한국) 국고채5년물 2.5조원 입찰	(일본) 12월 생산자물가지수 (영국) 11월 실업률 (미국) 1월 CB 소비자기대지수 (한국) 국고채20년물 1조원 입찰	(회의) FOMC(26~27일) (미국) 12월 내구재 주문(잠정)	(일본) 12월 소매판매 (독일) 1월 소비자물가지수 (유럽) 1월 소비자기대지수 (미국) 신규매주택매 (미국) 도매 재고(잠정)	(일본) 1월 소비자물가지수 (독일) 4분기 경제성장률(잠정) (미국) 1월 시카고 PMI (미국) 1월 소비자심리지수 (미국) 12월 개인소득 (미국) PCE 디플레이터	