

미래에셋증권 Daily

▶ TODAY'S REPORTS

퀀트전략

유명간: Earnings Revision(1월 1주차)

금융시장 주요 지표 I, II

2022. 1. 3 (월)

리서치센터

| | |
|-----------------------|----------------------|
| KOSPI (12/30) | 2,977.65P(-15.64P) |
| KOSDAQ (12/30) | 1,033.98P(+5.93P) |
| KOSPI200 (12/30) | 394.19P(-2.53P) |
| 미국 DowJones지수 (12/31) | 36,338.30P(-59.78P) |
| 미국 NASDAQ지수 (12/31) | 15,644.97P(-96.59P) |
| 중국상해종합지수 (12/31) | 3,639.78P(+20.59P) |
| NIKKEI225지수 (12/30) | 28,791.71P(-115.17P) |
| 유럽 STOXX600지수 (12/31) | 487.80P(-0.91P) |
| 독일 DAX지수 (12/30) | 15,884.86P(+32.61P) |
| VIX (12/31) | 17.22P(-0.11P) |
| 원/달러 환율 (12/31) | 1,189.88(+0.83) |
| 엔/달러 환율 (12/31) | 115.08(0.00) |
| 달러/유로 환율 (12/31) | 1.14(+0.01) |
| 국고채 수익률(3년) (12/31) | 1.80(0.00) |
| 미국채 10년 (12/31) | 1.51(0.00) |
| 독일국채 10년 (12/31) | -0.18(0.00) |
| 금가격 (12/31) | 1,828.60(+14.50) |
| 구리가격 (12/31) | 9,682.00(+25.50) |
| 유가(WTI) (12/31) | 75.21(-1.78) |
| 국내주식형펀드증감 (12/28) | 2,850억원 |
| 해외주식형펀드증감 (12/28) | -431억원 |
| 고객예탁금 (12/30) | 696,535억원(+16,520억원) |
| 신용잔고 (12/30) | 230,972억원(-516억원) |
| 대차잔고 (12/30) | 671,109억원(-11,596억원) |

주: 현지 시간 기준

Earnings Revision(1월 첫째주)

2022.1.3

유명간 myounggan.yoo@miraeasset.com

황지애 jiae.hwang@miraeasset.com

전세계 주식시장의 이익동향

- 전세계 12개월 선행 EPS는 지난달 대비 +0.4% 상향 조정 (선진국: +0.5%) 신흥국: +0.02%)
- 국가별로 보면 미국(+0.6%), 일본(+1.2%), 한국(+0.9%)은 상향 조정. 중국(-0.9%), 홍콩(-0.6%), 호주(-0.8%)는 하향 조정
- 업종별로 보면 헬스케어(+1.7%), 산업재(+0.8%), 에너지(+0.7%)가 양호했고, 경기소비재(-0.5%), 유틸리티(-0.5%)는 부진한 모습

그림 1. 글로벌 12MF EPS 추이(-4Y=100)

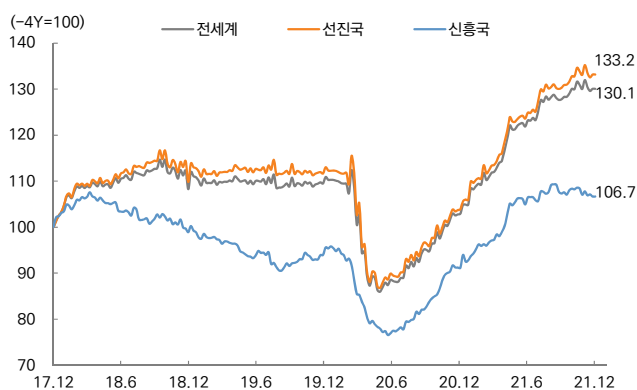


그림 2. 글로벌 12MF EPS 변화율

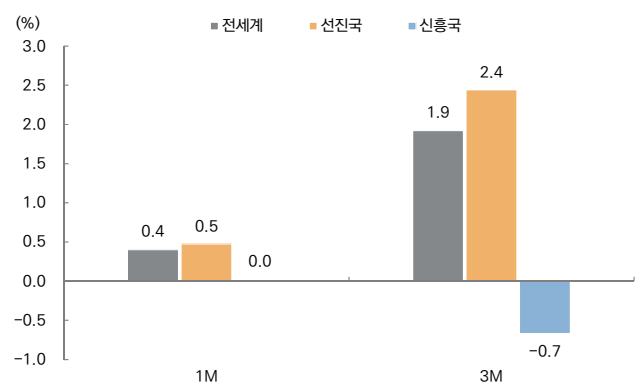


그림 3. 선진국 국가별 12MF EPS 변화율(1M)

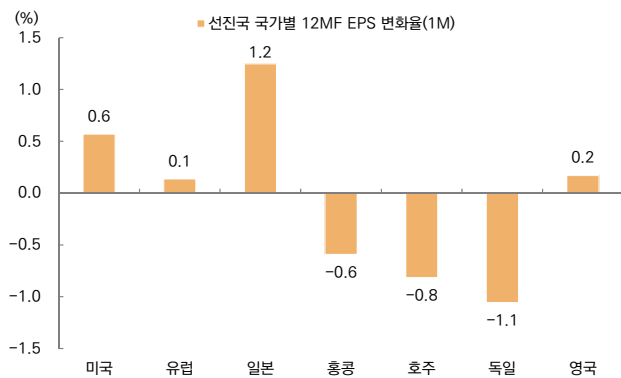


그림 4. 신흥국 국가별 12MF EPS 변화율(1M)

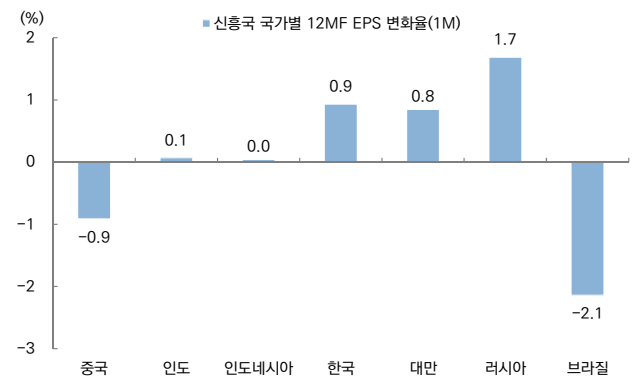


그림 5. 선진국 업종별 12MF EPS 변화율(1M)

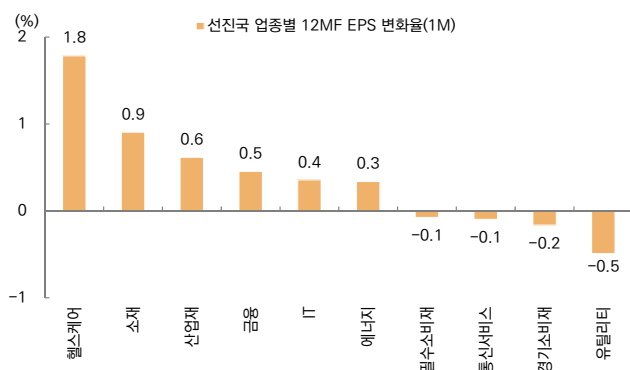
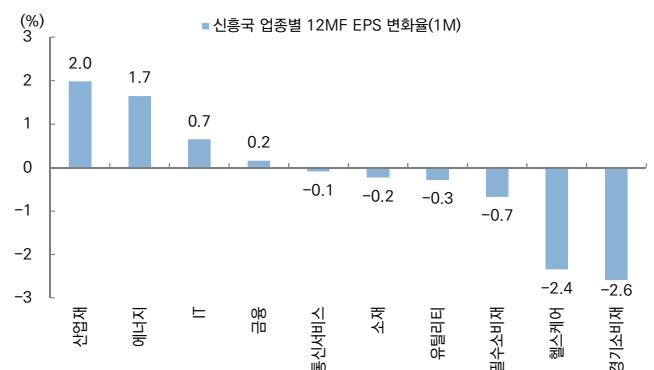


그림 6. 신흥국 업종별 12MF EPS 변화율(1M)



자료: Refinitiv, 미래에셋증권 리서치센터

전세계 주식시장의 밸류에이션

그림 7. 글로벌 12MF PER 추이



그림 8. 주요국 12MF PER 추이

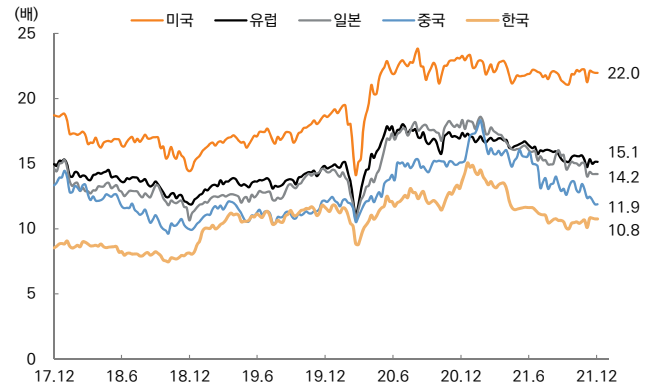


그림 9. 선진국 국가별 12MF PER 밴드(3Y)

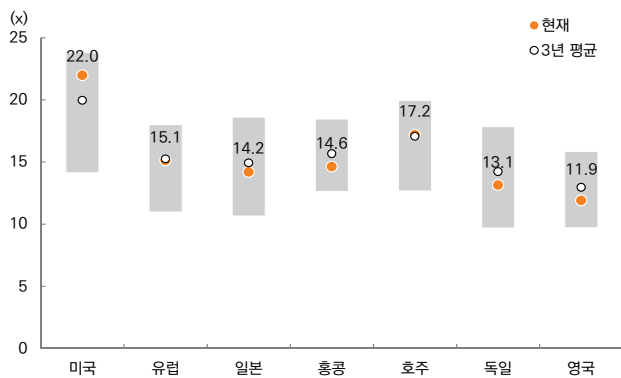


그림 10. 신흥국 국가별 12MF PER 밴드(3Y)

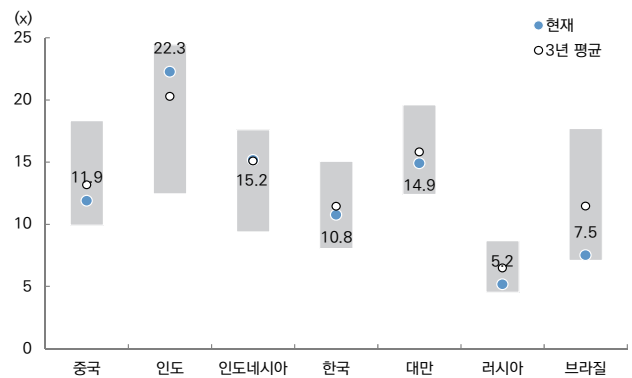


그림 11. 선진국 업종별 12MF PER 밴드(3Y)

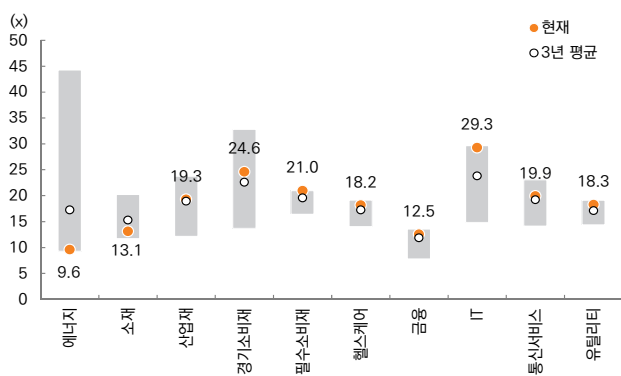
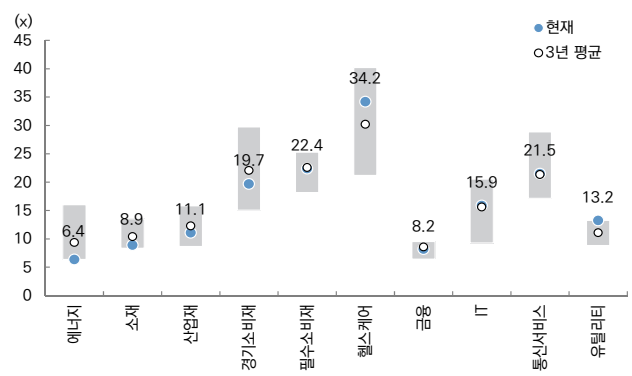


그림 12. 신흥국 업종별 12MF PER 밴드(3Y)



자료: Refinitiv, 미래에셋증권 리서치센터

전세계 업종별 이익동향

- 전세계 기업의 12MF 순이익 전망치는 2주 전 대비 -0.1% 하향 조정됨(컨센서스가 존재하는 2,062사 기준)
- 2주간 12MF 순이익 전망치 상향 조정 폭이 큰 업종은 반도체, 운송, 화장품/의류
- 2주간 12MF 순이익 전망치 하향 조정 폭이 큰 업종은 호텔/레저, 유틸리티, 철강

그림 13. 전세계 업종별 12MF 순이익 전망치 변화율(2W)

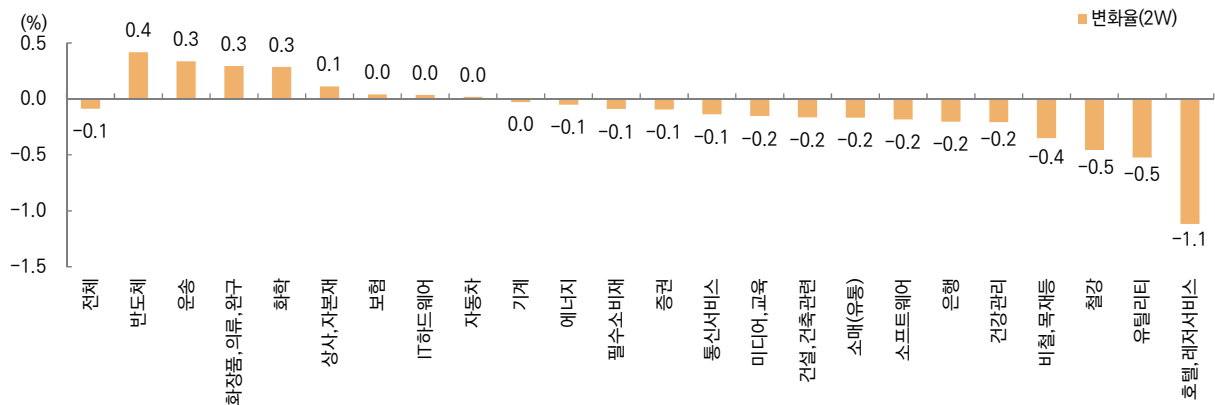
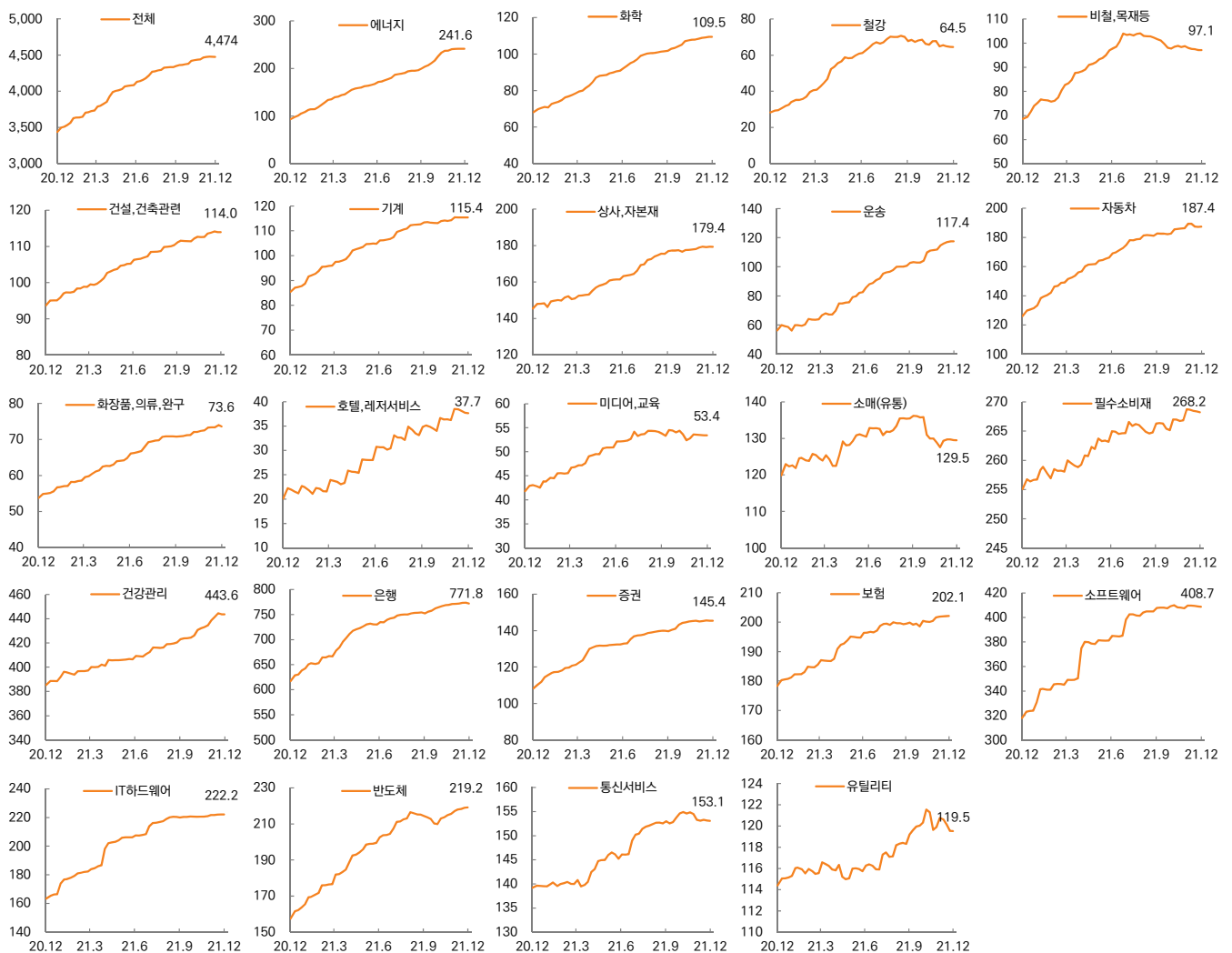


그림 14. 전세계 업종별 12MF 순이익 전망치 추이 (컨센서스 기준) (USD bn)



주: MSCI AC WORLD 내 12MF 순이익 컨센서스가 과거 1년동안 연속적으로 존재하는 기업 기준

자료: Refinitiv, 미래에셋증권 리서치센터

선진국 업종별 이익동향

- 선진국의 12MF 순이익 전망치는 2주 전 대비 소폭 하향 조정됨(컨센서스가 존재하는 1,273사 기준)
- 2주간 12MF 순이익 전망치 상향 조정 폭이 큰 업종은 운송, 반도체, 화장품/의류
- 2주간 12MF 순이익 전망치 하향 조정 폭이 큰 업종은 철강, 비철금속, 호텔/레저

그림 15. 선진국의 업종별 12MF 순이익 전망치 변화율(2W)

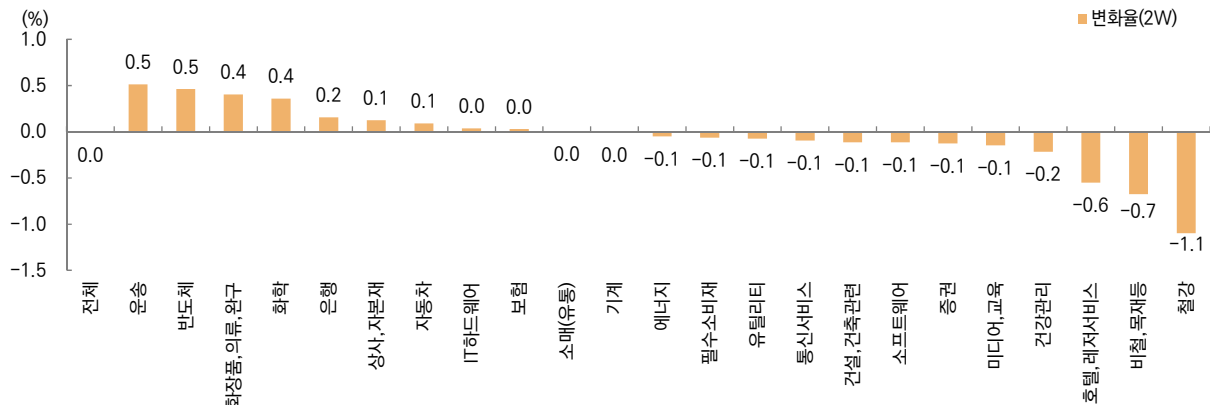
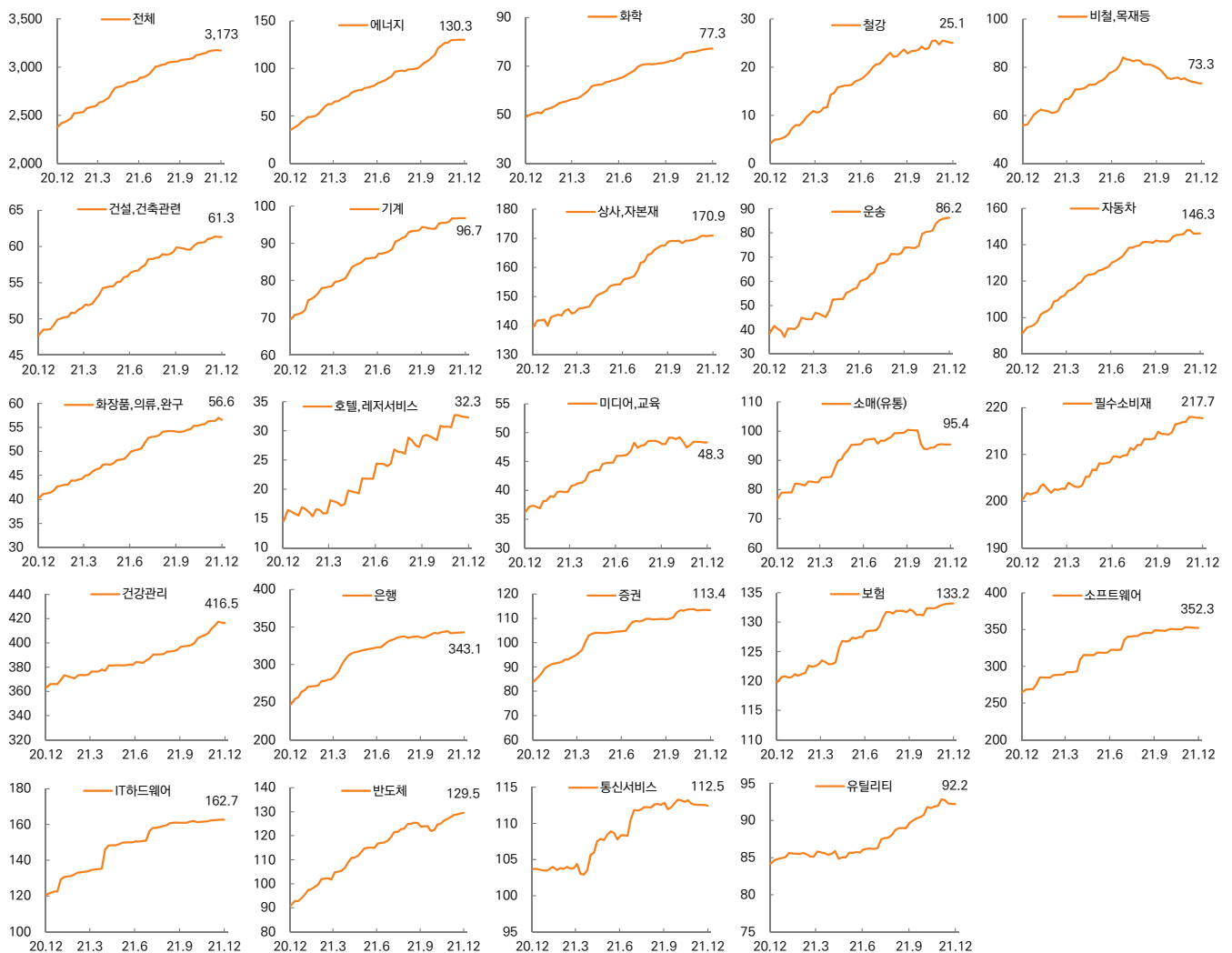


그림 16. 선진국의 업종별 12MF 순이익 전망치 추이 (컨센서스 기준) (USD bn)



주: MSCI WORLD 내 12MF 순이익의 컨센서스가 과거 1년동안 연속적으로 존재하는 기업 기준

자료: Refinitiv, 미래에셋증권 리서치센터

신흥국 업종별 이익동향

- 신흥국의 12MF 순이익 전망치는 2주 전 대비 -0.3% 하향 조정됨(컨센서스가 존재하는 789사 기준)
- 2주간 12MF 순이익 전망치 상향 조정 폭이 큰 업종은 비철금속, 반도체, 화학, 보험
- 2주간 12MF 순이익 전망치 하향 조정 폭이 큰 업종은 호텔/레저, 유틸리티, 소매(유통)

그림 17. 신흥국의 업종별 12MF 순이익의 전망치 변화율(2W)

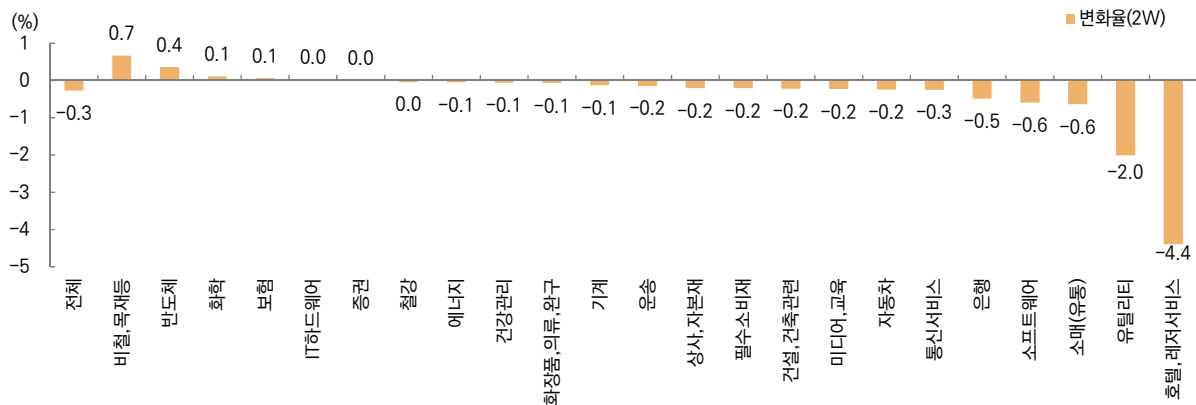
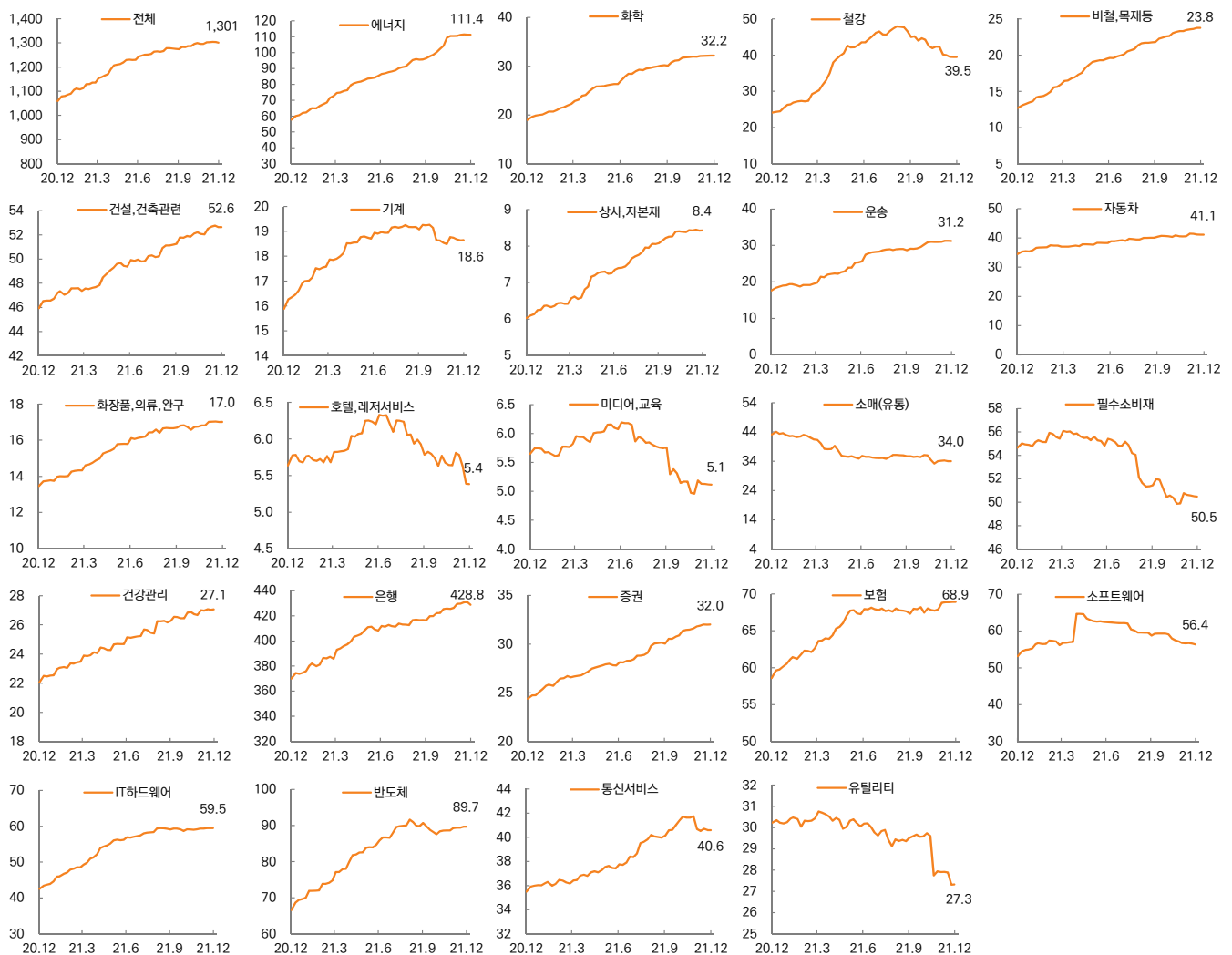


그림 18. 신흥국의 업종별 12MF 순이익의 전망치 추이 (컨센서스 기준) (USD bn)



주: MSCI EM 내 12MF 순이익 컨센서스가 과거 1년동안 연속적으로 존재하는 기업 기준

자료: Refinitiv, 미래에셋증권 리서치센터

미국 업종별 이익동향

- 미국 기업의 12MF 순이익 전망치는 2주 전 대비 소폭 상향 조정됨(컨센서스가 존재하는 588사 기준)
- 2주간 12MF 순이익 전망치 상향 조정 폭이 큰 업종은 화장품/의류, 자동차, 반도체
- 2주간 12MF 순이익 전망치 하향 조정 폭이 큰 업종은 철강, 호텔/레저, 건강관리, 미디어

그림 19. 미국 업종별 12MF 순이익 전망치 변화율(2W)

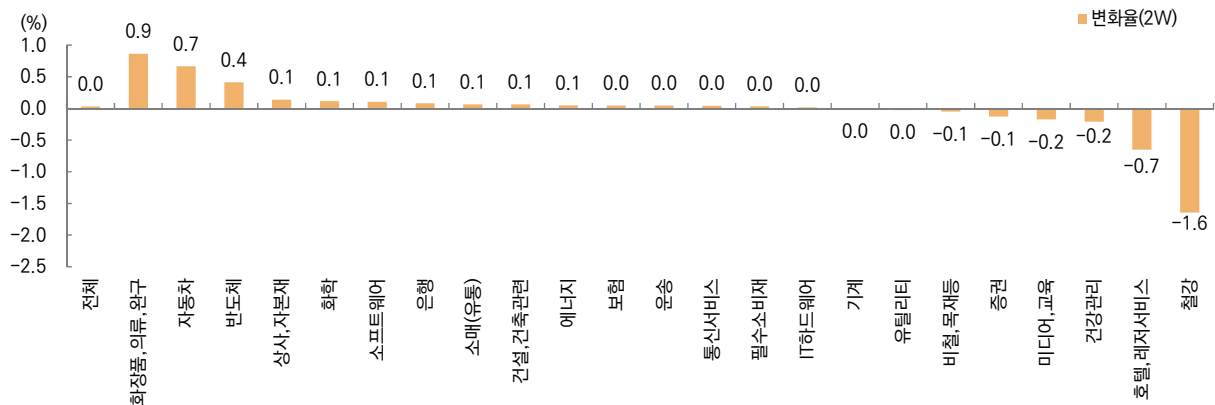
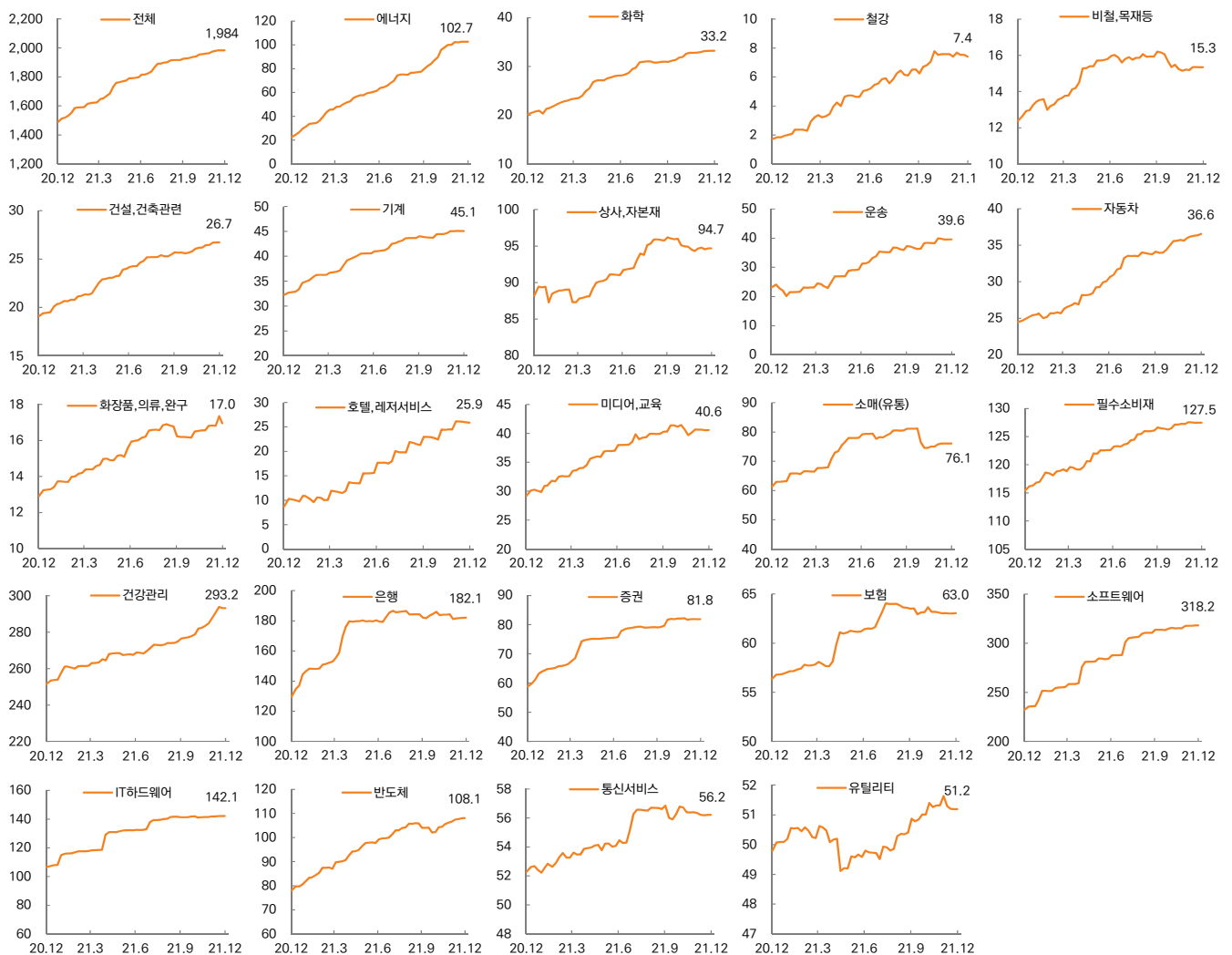


그림 20. 미국 업종별 12MF 순이익 전망치 추이 (컨센서스 기준) (USD bn)



주: MSCI USA 내 12MF 순이익의 컨센서스가 과거 1년동안 연속적으로 존재하는 기업 기준

자료: Refinitiv, 미래에셋증권 리서치센터

유럽 업종별 이익동향

- 유럽 기업의 12MF 순이익 전망치는 2주 전 대비 -0.2% 하향 조정됨(컨센서스가 존재하는 344사 기준)
- 2주간 12MF 순이익 전망치 상향 조정 폭이 큰 업종은 운송, 반도체, IT하드웨어
- 2주간 12MF 순이익 전망치 하향 조정 폭이 큰 업종은 소프트웨어, 철강, 비철금속

그림 21. 유럽 업종별 12MF 순이익 전망치 변화율(2W)

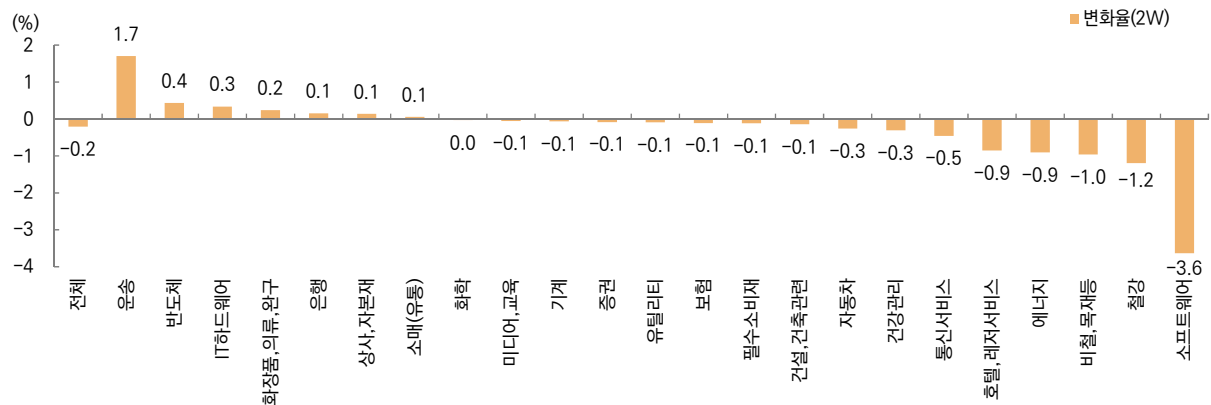
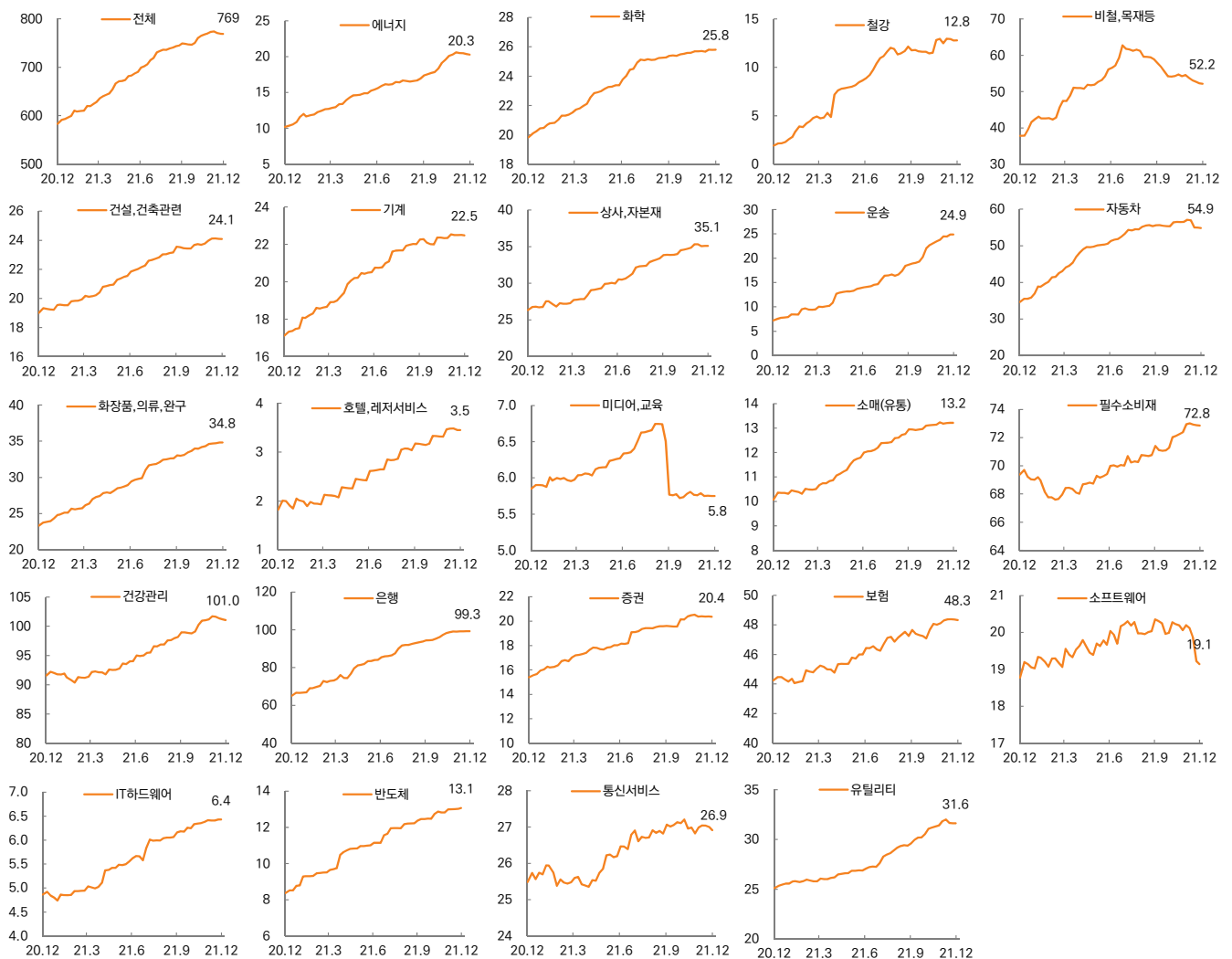


그림 22. 유럽 업종별 12MF 순이익 전망치 추이 (컨센서스 기준) (USD bn)



주: MSCI Europe 내 12MF 순이익 컨센서스가 과거 1년동안 연속적으로 존재하는 기업 기준

자료: Refinitiv, 미래에셋증권 리서치센터

일본 업종별 이익동향

- 일본 기업의 12MF 순이익 전망치는 2주 전 대비 +0.1% 상향 조정됨(컨센서스가 존재하는 290사 기준)
- 2주간 12MF 순이익 전망치 상향 조정 폭이 큰 업종은 비철금속, 에너지, 반도체, 화학
- 2주간 12MF 순이익 전망치 하향 조정 폭이 큰 업종은 소매(유통), 필수소비재, 유틸리티

그림 23. 일본 업종별 12MF 순이익 전망치 변화율(2W)

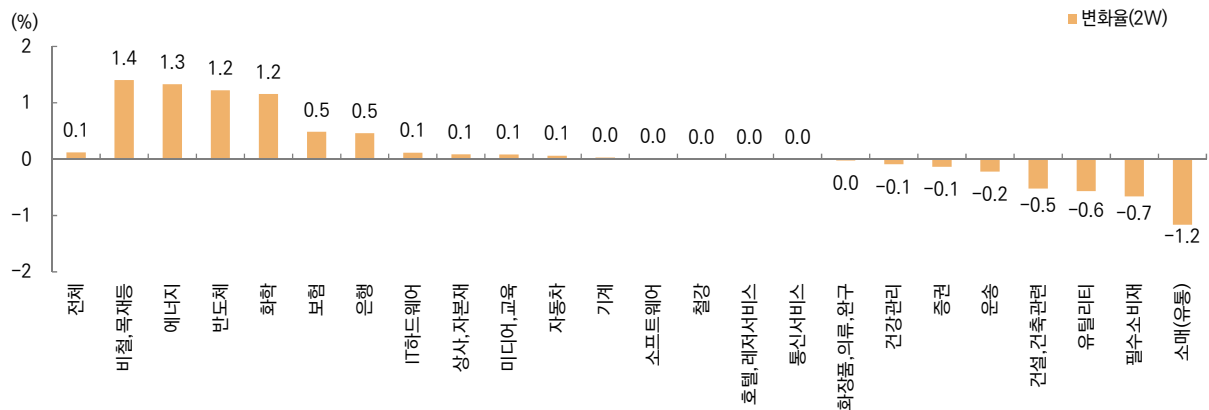
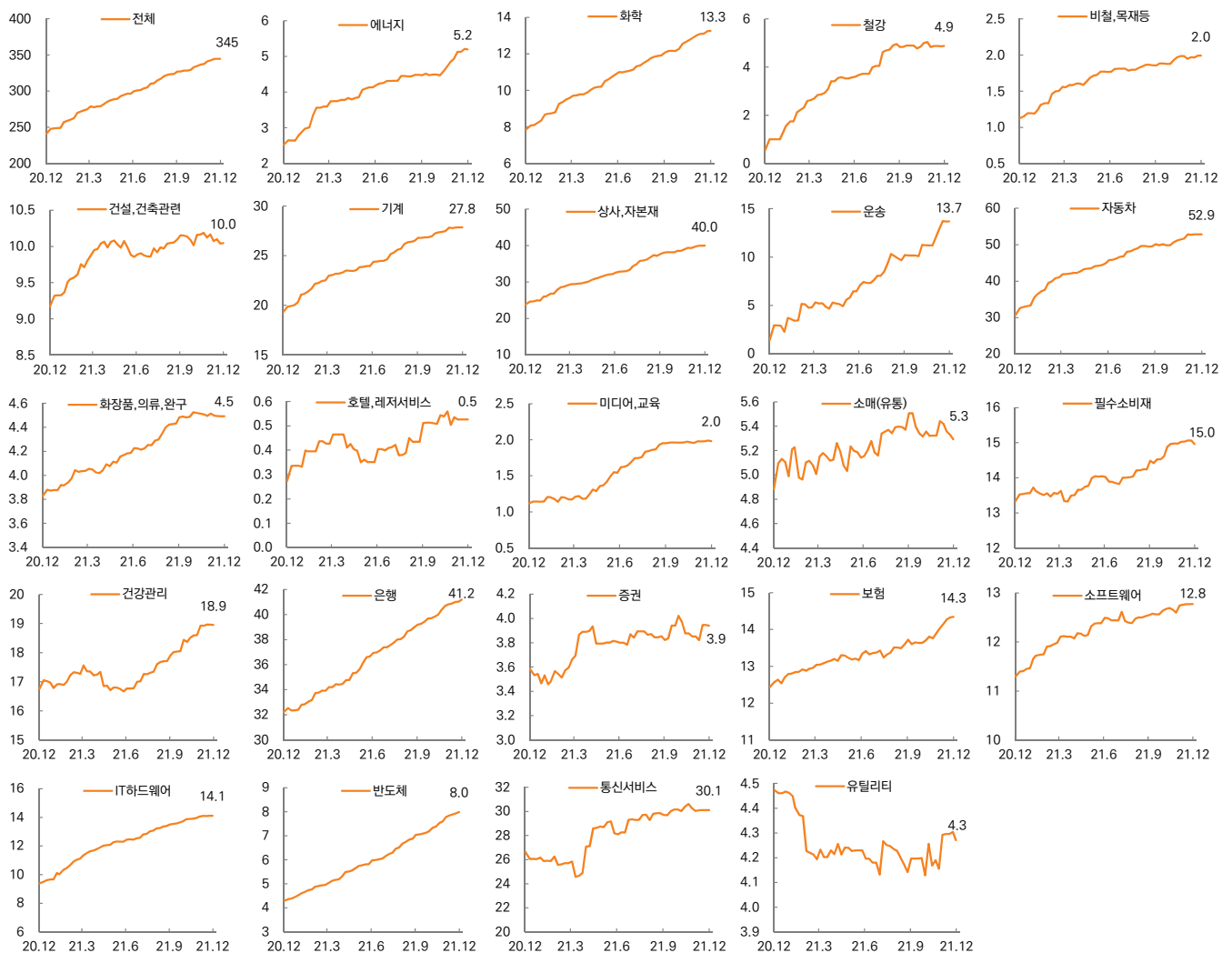


그림 24. 일본 업종별 12MF 순이익 전망치 추이 (컨센서스 기준) (USD bn)



주: MSCI Japan 내 12MF 순이익의 컨센서스가 과거 1년동안 연속적으로 존재하는 기업 기준

자료: Refinitiv, 미래에셋증권 리서치센터

중국 업종별 이익동향

- 중국 기업의 12MF 순이익 전망치는 2주 전 대비 +0.2% 상향 조정됨(컨센서스가 존재하는 503사 기준)
- 2주간 12MF 순이익 전망치 상향 조정 폭이 큰 업종은 비철금속, 화학, 보험, 반도체
- 2주간 12MF 순이익 전망치 하향 조정 폭이 큰 업종은 호텔/레저, 소프트웨어, 소매(유통)

그림 25. 중국 업종별 12MF 순이익 전망치 변화율(2W)

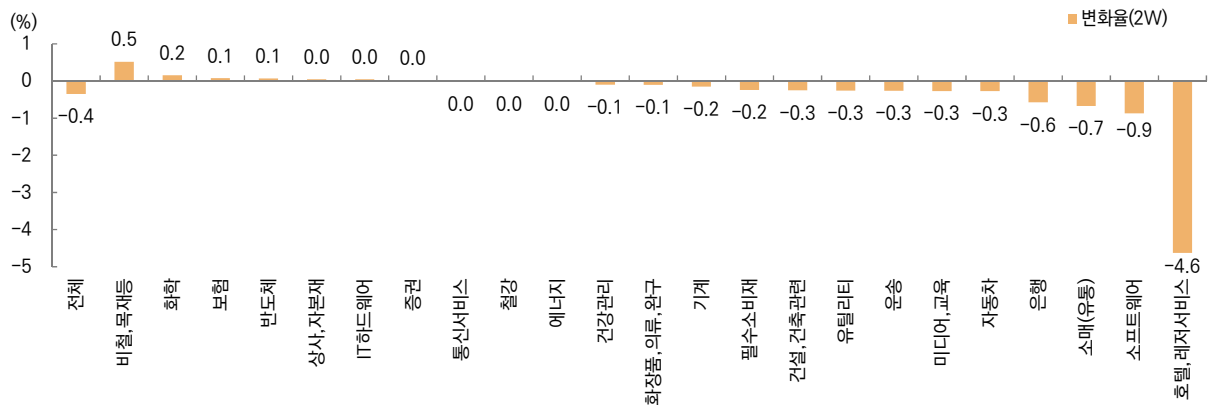
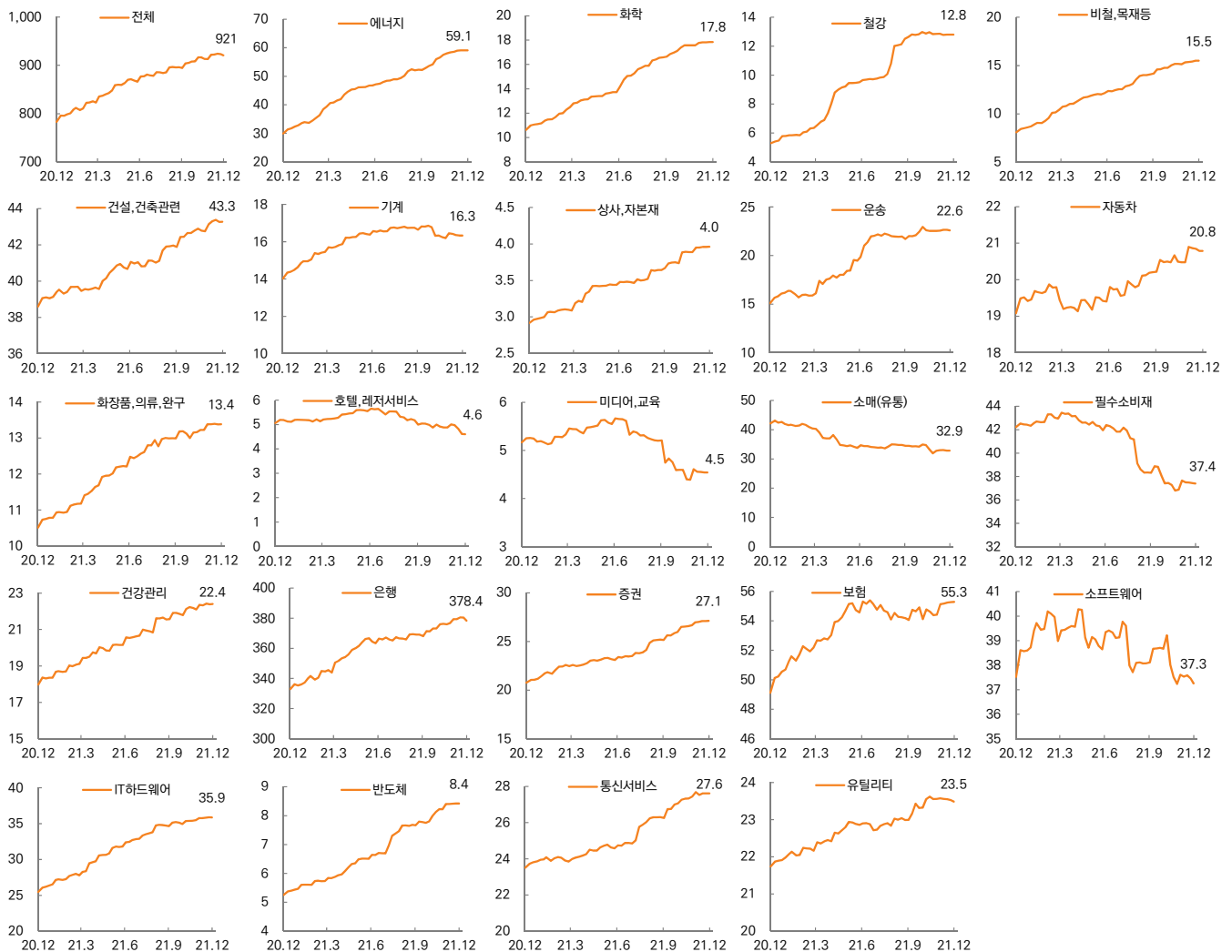


그림 26. 중국 업종별 12MF 순이익 전망치, 주가 추이 (컨센서스 기준) (USD bn)



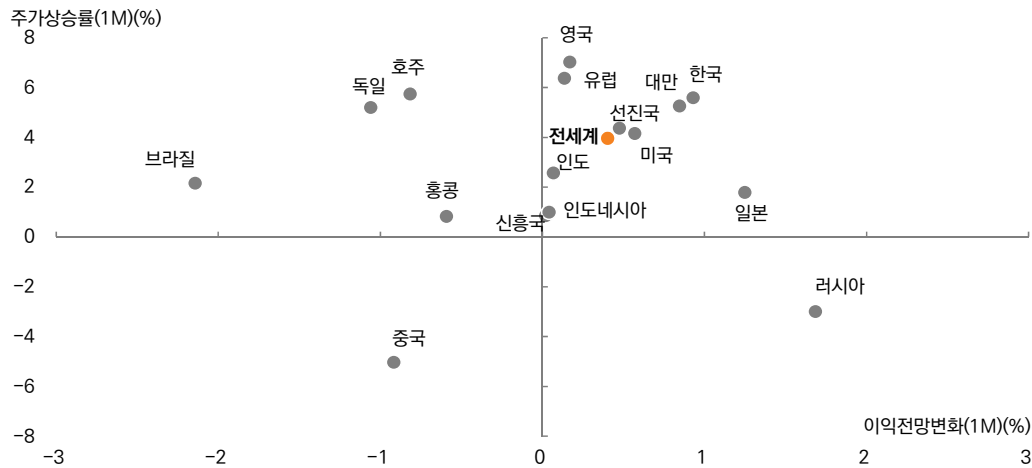
주: MSCI China내 12MF 순이익 컨센서스가 과거 1년동안 연속적으로 존재하는 기업 기준

자료: Refinitiv, 미래에셋증권 리서치센터

전세계 종목별 이익동향

- Airbnb의 2022년 매출액, 순이익 컨센서스는 73.7억달러(+24.5%YoY), 6.9억달러(흑자전환)로 실적 정상화 기대
- 3분기 순이익 8.3억달러 기록하며 19년도 실적 수준 회복. 하이엔드급 숙소의 직접예약 트렌드 증가하며 수익성 추가개선 전망
- 연말 모임 제재를 위한 다인/단기예약 제한에도 호텔 대비 독립적인 숙소 구조라는 이점, 산업 내 실적 방어기 기대

그림 27. 글로벌 주식시장 국가별 이익전망치 변화(1M) 대비 추가상승률(1M)



자료: Refinitiv, 미래에셋증권 리서치센터

표 1. 전세계 주식시장 이익전망치 상향 종목

| Local code | 종목명 | 국가 | 업종명 | 시가총액 | 12MF EPS Chg.(%) | | | 추가상승률(%) | | |
|------------|----------------------|-----|------------------------|-----------|------------------|------|-------|----------|-------|-------|
| | | | | (백만달러) | (1W) | (1M) | (3M) | (1W) | (1M) | (3M) |
| ABNB-US | AIRBNB INC | USA | Consumer Services | 105,688 | 3.2 | 18.5 | 487.7 | -1.5 | -2.2 | 0.6 |
| BA-US | BOEING CO | USA | Electronic Technology | 119,133 | 2.7 | 5.6 | 7.4 | -0.7 | 2.5 | -7.8 |
| 600809-CN | SHANXI XINGHUACUN | CHN | Consumer Non-Durables | 61,063 | 2.2 | 3.1 | 12.2 | 4.7 | 3.3 | 1.5 |
| TSLA-US | TESLA INC | USA | Consumer Durables | 1,074,900 | 1.4 | 7.5 | 30.7 | 0.3 | -6.5 | 38.0 |
| TWTR-US | TWITTER INC | USA | Technology Services | 35,551 | 1.3 | 6.6 | -21.5 | 0.7 | 1.2 | -26.4 |
| 300059-CN | EAST MONEY INFORMA | CHN | Technology Services | 60,038 | 1.3 | 1.2 | 13.8 | -1.1 | 6.9 | 7.8 |
| ZS-US | ZSCALER INC | USA | Technology Services | 45,469 | 1.1 | 0.2 | 9.8 | 0.5 | -6.5 | 23.8 |
| BKNG-US | BOOKING HOLDINGS INC | USA | Consumer Services | 98,385 | 1.1 | 5.4 | 19.6 | -0.3 | 14.0 | 0.9 |
| PDD-US | PINDUODUO INC | CHN | Retail Trade | 74,508 | 1.0 | 8.5 | 302.2 | 3.0 | -10.6 | -34.4 |
| 300750-CN | CONTEMPORARY AMPER | CHN | Producer Manufacturing | 213,849 | 0.9 | 4.7 | 23.0 | -5.2 | -13.2 | 12.2 |

표 2. 전세계 주식시장 이익전망치 하향 종목

| Local code | 종목명 | 국가 | 업종명 | 시가총액 | 12MF EPS Chg.(%) | | | 추가상승률(%) | | |
|------------|---------------------------|-----|------------------------|---------|------------------|----------|--------|----------|------|-------|
| | | | | (백만달러) | (1W) | (1M) | (3M) | (1W) | (1M) | (3M) |
| CLNX-ES | CELLNEX TELECOM SA | ESP | Communications | 39,382 | -86.7 | -2,895.2 | -182.4 | 4.3 | -1.7 | -4.0 |
| RIO-GB | RIO TINTO | GBR | Non-Energy Minerals | 107,023 | -1.7 | -7.3 | -21.4 | 0.7 | 6.3 | -0.3 |
| NOVN-CH | NOVARTIS AG | CHE | Health Technology | 195,412 | -0.9 | -2.8 | -3.8 | 0.3 | 9.3 | 4.5 |
| GS-US | GOLDMAN SACHS GROUP INC | USA | Finance | 129,069 | -0.9 | -2.6 | -3.4 | 0.1 | 1.2 | 2.0 |
| UBSG-CH | UBS GROUP AG | CHE | Finance | 61,917 | -0.8 | -2.1 | 2.8 | -0.1 | 3.0 | 9.5 |
| REGN-US | REGENERON PHARMACEUTICALS | USA | Health Technology | 69,114 | -0.8 | -2.0 | -1.2 | 2.7 | 0.9 | 6.2 |
| INTC-US | INTEL CORP | USA | Electronic Technology | 210,427 | -0.8 | -3.4 | -17.7 | 0.8 | 5.2 | -2.9 |
| COF-US | CAPITAL ONE FINL CORP | USA | Finance | 61,924 | -0.7 | -2.9 | -1.1 | 0.3 | 3.5 | -10.2 |
| DOW-US | DOW INC | USA | Process Industries | 41,995 | -0.7 | -3.3 | -4.9 | 3.0 | 3.4 | -1.4 |
| ABB-CH | ABB LTD | CHE | Producer Manufacturing | 76,089 | -0.6 | -0.6 | -1.6 | 0.8 | 9.4 | 11.2 |

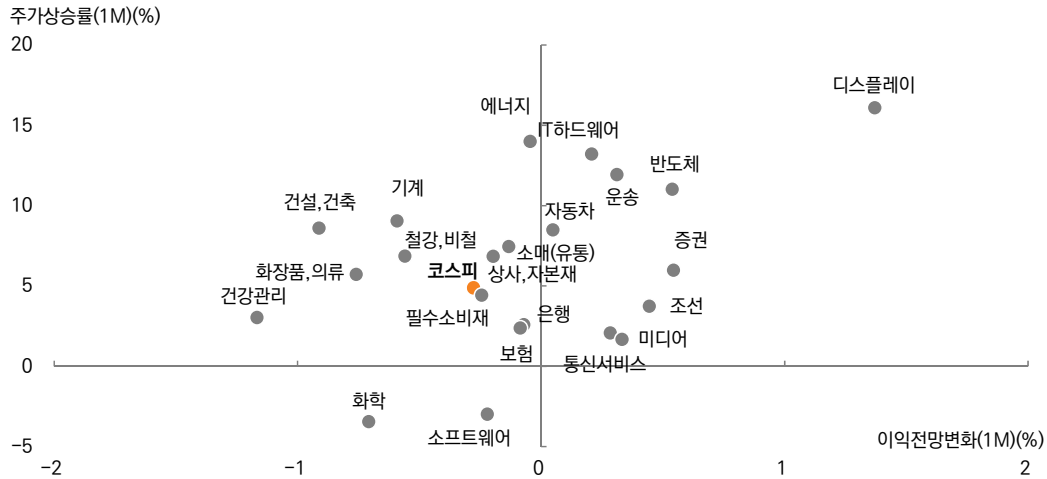
주: 미래에셋증권 글로벌 유니버스는 전세계 시가총액 상위 500위에 포함되어 있고, EPS 추정치가 20개 이상인 종목

자료: Factset, 미래에셋증권 리서치센터

한국 주식시장의 이익동향

- 저평가 업종(KOSPI 대비 이익전망치 상향 조정, 주가상승률 낮은 업종)은 통신서비스, 미디어, 조선, 은행, 보험, 소프트웨어
- 고평가 업종(KOSPI 대비 이익전망치 하향 조정, 주가상승률 높은 업종)은 철강/비철, 건설/건축, 기계, 화장품/의류, 호텔/레저
- 서울반도체의 4분기 매출액, 영업이익 컨센서스는 3,191억원(+2.8%YoY), 210억원(+44.0%YoY)으로 실적 개선 기대
- 전장용 LED 고객사 확대 및 OLED 공급 차질 지속에 따른 TV형 미니 LED 수요 증가가 예상
- 기존 반도체, 패널 수급 이슈에 따른 매출 차질에도 시장의 성장성과 점유율 수준은 유지될 전망, 22년 정상화 기대

그림 28. 한국 주식시장 업종별 이익전망치 변화(1M) 대비 주가상승률(1M)



자료: WISEfn, 미래에셋증권 리서치센터

표 3. 한국 주식시장 이익전망치 상향 종목

(단위: 억원, %, X)

| 종목코드 | 종목명 | 업종명 | 시가총액 | 2022년 영업이익 컨센서스 | | 컨센서스 변화율(2W) | 주간 주가상승률 | 2022년 | | |
|---------|----------|---------|---------|-----------------|---------|-----------------|-------------|-------|-----|------|
| | | | | 현재 | 2주전 | | | P/E | P/B | ROE |
| A010620 | 현대미포조선 | 조선 | 27,960 | 1,079 | 1,011 | 6.8 | 0.4 | 36.1 | 1.2 | 3.4 |
| A097520 | 엠씨넥스 | IT하드웨어 | 10,335 | 830 | 794 | 4.6 | 2.7 | 14.5 | 2.9 | 22.7 |
| A047810 | 한국항공우주 | 상사, 자본재 | 31,631 | 1,468 | 1,416 | 3.7 | 1.7 | 33.2 | 2.4 | 7.4 |
| A047050 | 포스코인터내셔널 | 상사, 자본재 | 27,698 | 6,376 | 6,223 | 2.5 | -3.4 | 6.8 | 0.7 | 11.4 |
| A046890 | 서울반도체 | 디스플레이 | 8,979 | 1,002 | 979 | 2.4 | 2.3 | 14.4 | 1.1 | 8.3 |
| A049770 | 동원F&B | 필수소비재 | 7,506 | 1,506 | 1,474 | 2.2 | 0.3 | 7.1 | 0.8 | 12.2 |
| A009540 | 한국조선해양 | 조선 | 66,951 | 3,143 | 3,083 | 2.0 | 0.4 | 38.8 | 0.6 | 1.6 |
| A060720 | KH바텍 | IT하드웨어 | 6,322 | 535 | 526 | 1.8 | 11.5 | 13.9 | 2.4 | 19.4 |
| A000660 | SK하이닉스 | 반도체 | 953,683 | 128,033 | 125,848 | 1.7 | 2.7 | 9.9 | 1.3 | 14.7 |
| A091700 | 파트론 | IT하드웨어 | 7,203 | 892 | 877 | 1.7 | 1.5 | 11.4 | 1.6 | 15.7 |

표 4. 한국 주식시장 이익전망치 하향 종목

| 종목코드 | 종목명 | 업종명 | 시가총액 | 2022년 영업이익 컨센서스 | | 컨센서스 변화율(2W) | 주간 주가상승률 | 2022년 | | |
|---------|--------|-------------|---------|-----------------|---------|-----------------|-------------|-------|------|--------|
| | | | | 현재(A) | 2주전(B) | | | P/E | P/B | ROE |
| A015760 | 한국전력 | 유틸리티 | 141,874 | -56,796 | -49,177 | -15.5 | 3.5 | -2.9 | 0.2 | -7.9 |
| A079160 | CJ CGV | 미디어, 교육 | 9,507 | 544 | 628 | -13.4 | 2.5 | -19.8 | 55.0 | -115.0 |
| A017810 | 풀무원 | 필수소비재 | 6,595 | 675 | 744 | -9.2 | -1.1 | 19.6 | 1.4 | 7.7 |
| A298040 | 효성중공업 | 기계 | 5,436 | 1,691 | 1,811 | -6.6 | -1.2 | 6.3 | 0.5 | 8.8 |
| A002790 | 아모레G | 화장품, 의류, 완구 | 36,570 | 5,044 | 5,311 | -5.0 | -2.4 | 20.0 | 1.1 | 6.0 |
| A036420 | 제이콘텐트리 | 미디어, 교육 | 9,990 | 394 | 415 | -4.9 | 11.0 | 50.0 | 5.5 | 11.9 |
| A069080 | 웹젠 | 소프트웨어 | 10,205 | 994 | 1,036 | -4.0 | -2.5 | 11.8 | 1.4 | 15.4 |
| A042660 | 대우조선해양 | 조선 | 24,731 | -731 | -705 | -3.6 | -0.2 | -17.2 | 1.0 | -5.5 |
| A071840 | 롯데하이마트 | 소매(유통) | 5,937 | 1,477 | 1,517 | -2.6 | -0.2 | 6.9 | 0.3 | 4.3 |
| A267260 | 현대일렉트릭 | 기계 | 7,173 | 1,144 | 1,174 | -2.6 | -2.9 | 9.6 | 0.9 | 9.9 |

주1: 시가총액 5,000억원 이상, EPS 추정치 3개 이상인 종목

주2: 적자폭 축소 기업은 이익전망치 상향 조정 종목에서 제외

자료: WISEfn, 미래에셋증권 리서치센터

한국 업종별 2022년 영업이익 전망치 변화

- 한국 기업의 2022년 영업이익 전망치는 2주 전 대비 -0.2% 하향 조정된 230.4조원 기록(컨센서스가 존재하는 252사 기준)
- 2주간 2022년 영업이익 전망치 상향 조정 폭이 큰 업종은 반도체, 디스플레이, IT하드웨어
- 2주간 2022년 영업이익 전망치 하향 조정 폭이 큰 업종은 유틸리티, 기계, 화학

그림 29. 한국 업종별 2022년 영업이익 전망치 변화율(2W)

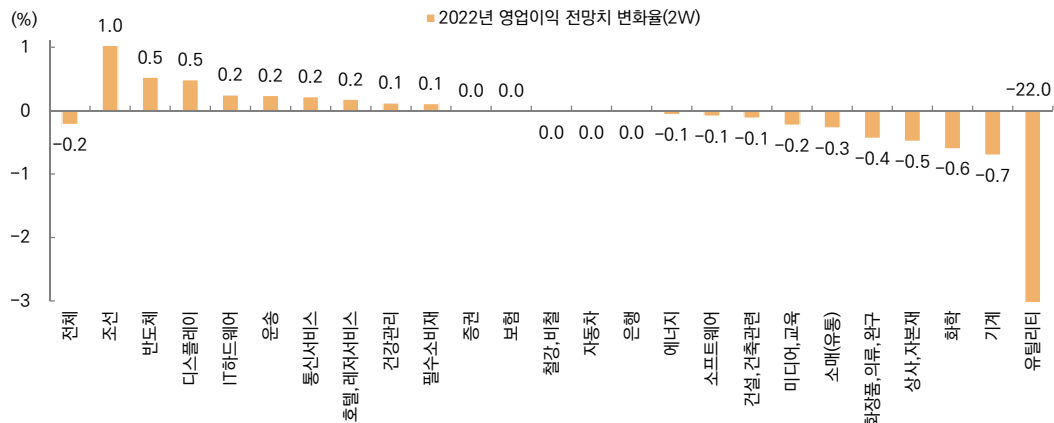
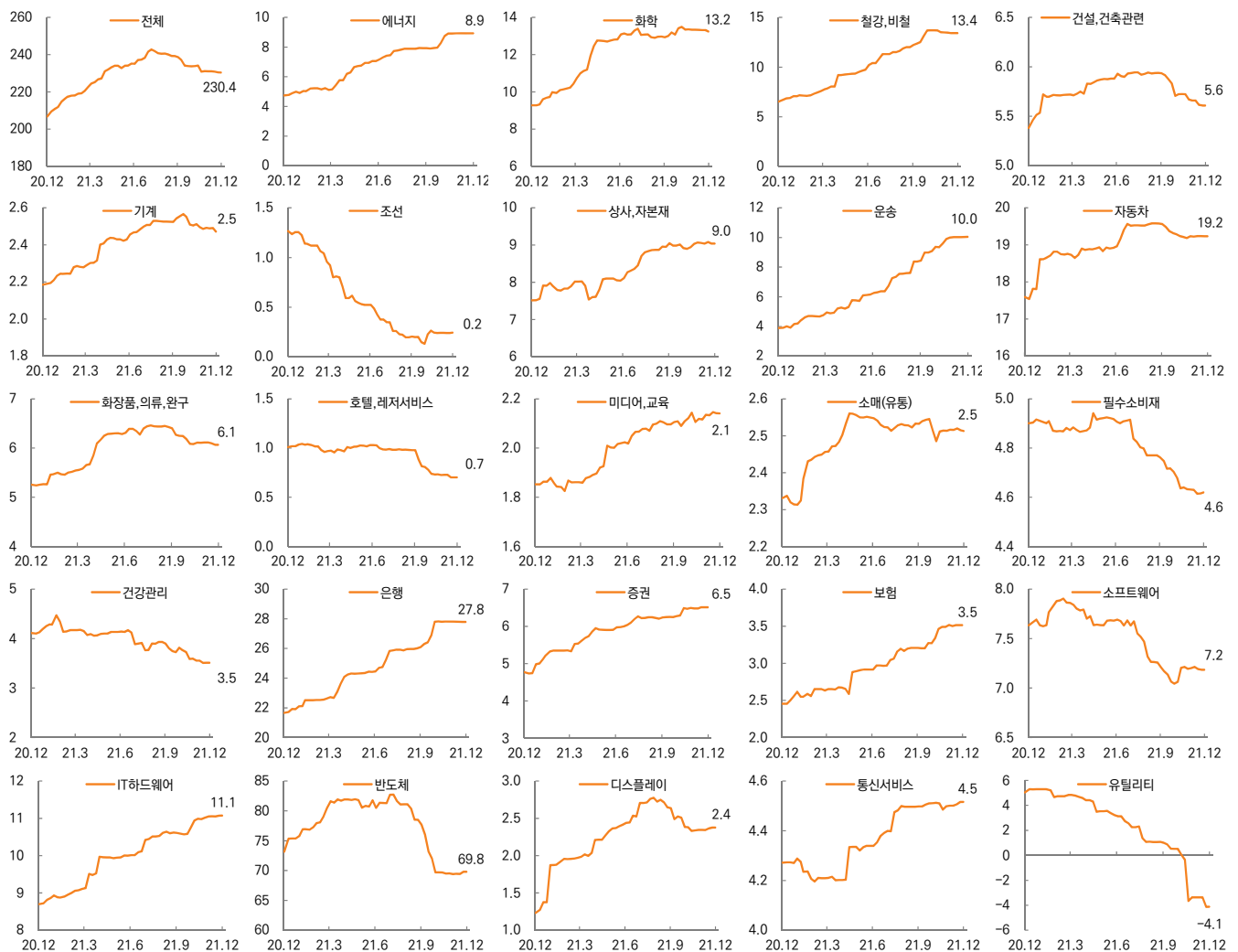


그림 30. 업종별 2022년 영업이익 전망치 추이 (컨센서스 기준) (조원)



주: 2022년 영업이익 컨센서스가 과거 1년 동안 연속적으로 존재하는 기업 기준

자료: WISEfn, 미래에셋증권 리서치센터

한국 업종별 분기 영업이익의 전망치 변화

- 한국 기업의 2021년 4/4분기 영업이익의 전망치는 2주 전 대비 -0.8% 하향 조정된 56.4조원 기록
- 2주간 4/4분기 영업이익의 전망치 상향 조정 폭이 큰 업종은 호텔/레저, 디스플레이, 운송
- 2주간 4/4분기 영업이익의 전망치 하향 조정 폭이 큰 업종은 조선, 유틸리티, 기계

그림 31. 한국 업종별 2021년 4/4분기 영업이익의 전망치 변화율(2W)

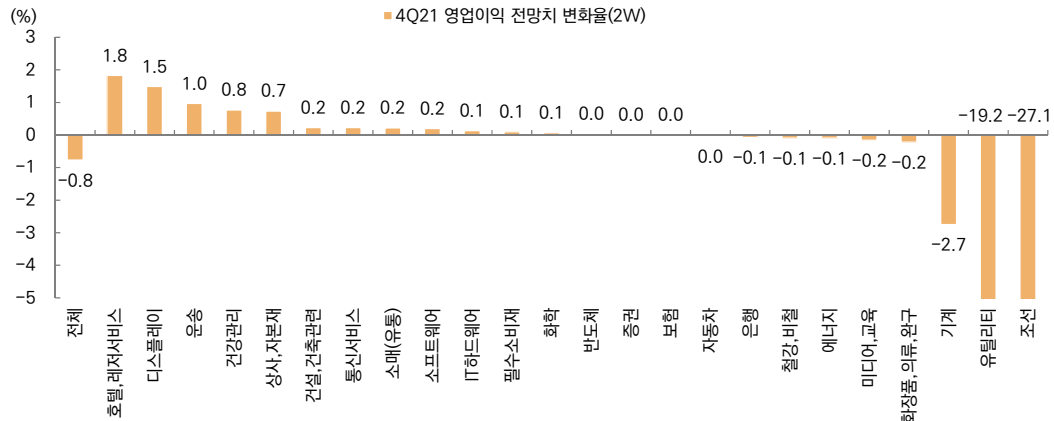
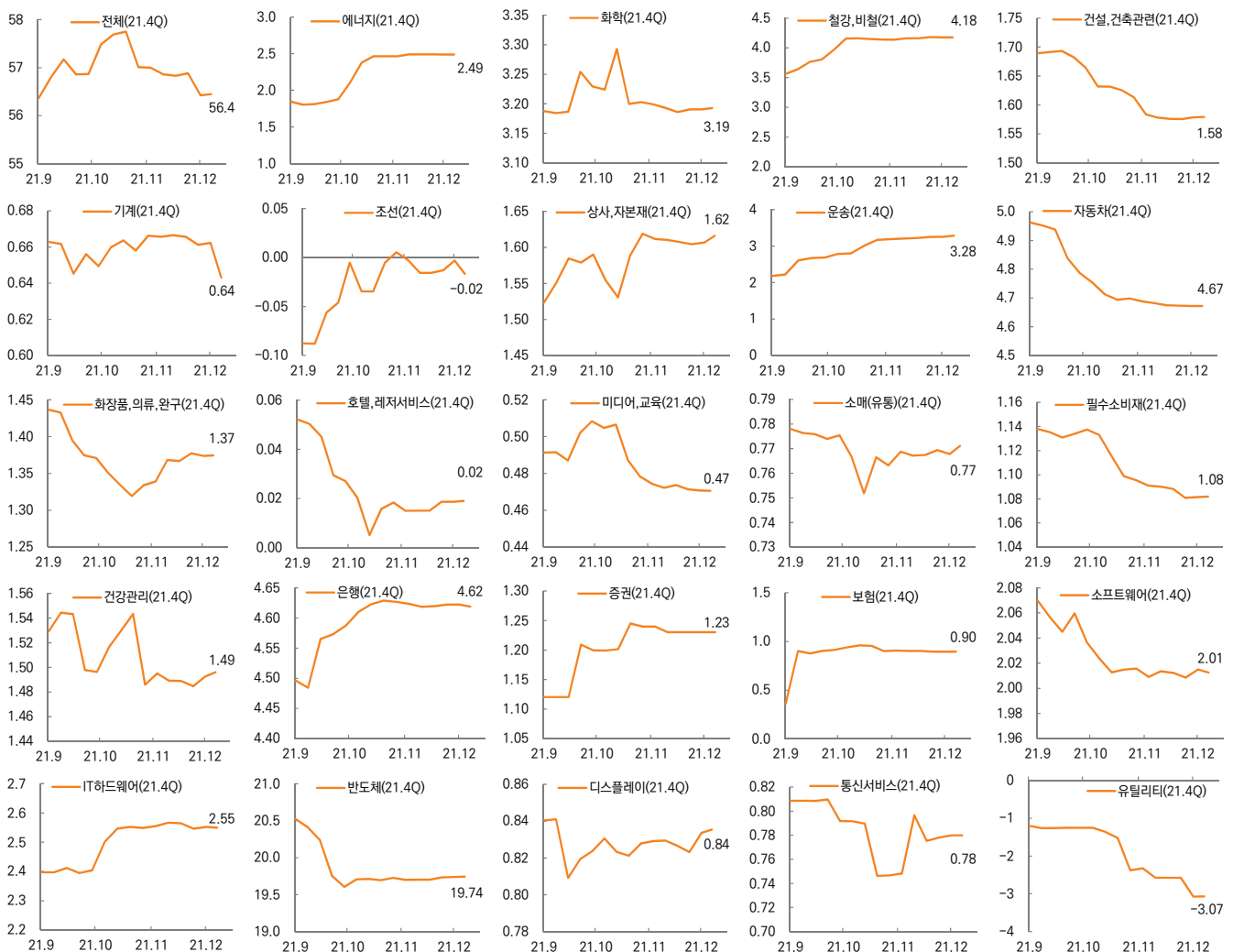


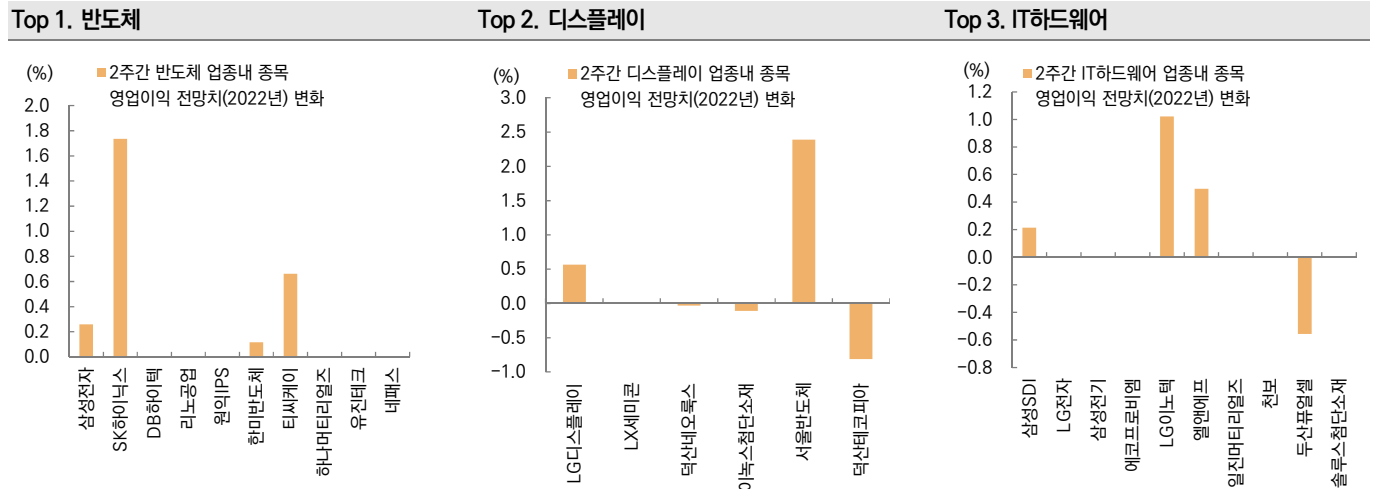
그림 32. 업종별 2021년 4/4분기 영업이익의 전망치 추이 (컨센서스 기준) (조원)



주: 분기별 영업이익의 컨센서스가 과거 3개월 동안 연속적으로 존재하는 기업 기준

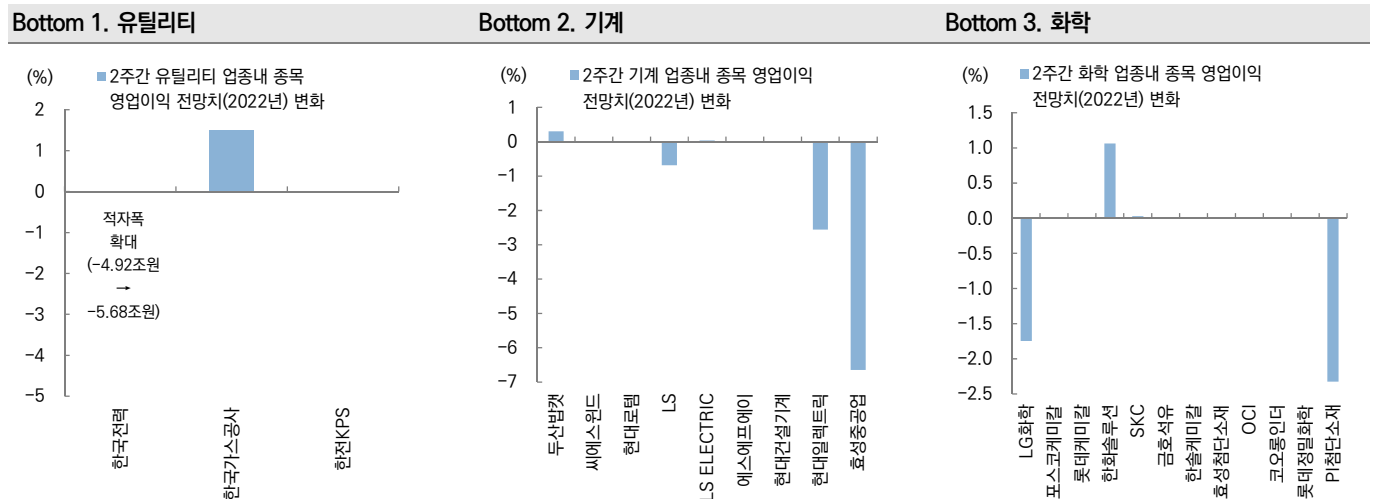
자료: WISEfn, 미래에셋증권 리서치센터

한국 2022년 이익변화 상위 업종



자료: WISEfn, 미래에셋증권 리서치센터

한국 2022년 이익변화 하위 업종



자료: WISEfn, 미래에셋증권 리서치센터

금융시장 주요 지표 I

2022. 1. 3 (월)

한국/아시아

(p, %)

| | Price | 1D | 1W | 1M | 3M | 1Y |
|----------------------|-----------|-------|-------|-------|-------|--------|
| KOSPI (12/30) | 2,977.65 | -0.52 | -0.68 | 4.88 | -1.38 | 3.63 |
| KOSDAQ (12/30) | 1,033.98 | 0.58 | 3.06 | 7.08 | 5.16 | 6.77 |
| KOSPI200 (12/30) | 394.19 | -0.64 | -0.99 | 5.61 | -0.15 | 1.26 |
| 일본 NIKKEI225 (12/30) | 28,791.71 | -0.40 | -0.02 | 3.49 | 0.07 | 4.91 |
| 중국 상해종합 (12/31) | 3,639.78 | 0.57 | 0.60 | 1.76 | 2.01 | 4.80 |
| 홍콩 항셱 (12/31) | 23,397.67 | 1.24 | 0.75 | -1.10 | -4.79 | -14.08 |
| 홍콩 HSCFI (12/31) | 8,236.35 | 1.73 | 0.42 | -2.25 | -5.62 | -23.30 |
| 대만 TWSE (12/30) | 18,218.84 | -0.16 | 1.52 | 4.54 | 9.94 | 24.04 |
| 인도 SENSEX (12/31) | 58,253.82 | 0.80 | 1.98 | 0.99 | -0.87 | 21.99 |
| 베트남 VSI (12/31) | 1,498.28 | 0.83 | 1.44 | 0.88 | 12.24 | 35.73 |
| 인도네시아 JCI (12/30) | 6,581.48 | -0.29 | 0.40 | 0.73 | 5.66 | 9.03 |

환율

(각국 통화 단위, %)

| | Price | 1D | 1W | 1M | 3M | 1Y |
|-------------------|----------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 원/달러 (12/31) | 1,189.88 | 0.07 | 0.29 | 0.92 | 0.16 | 9.51 |
| 달러/유로 (12/31) | 1.14 | 0.40 | 0.45 | 0.44 | -1.95 | -6.93 |
| 엔/달러 (12/31) | 115.08 | 0.00 | 0.61 | 2.04 | 3.63 | 11.46 |
| 원/엔(100엔) (12/31) | 1,032.96 | -0.06 | -0.44 | -1.03 | -2.82 | -1.74 |
| 위안/달러 (12/31) | 6.36 | -0.27 | -0.18 | -0.19 | -1.38 | -2.62 |
| 달러인덱스 (12/31) | 95.67 | -0.31 | -0.36 | -0.37 | 1.74 | 6.37 |
| 원/해알 (12/31) | 213.57 | 0.04 | 2.15 | 2.88 | -3.47 | 2.84 |
| 해알/달러 (12/31) | 5.58 | 0.11 | -1.79 | -1.85 | 3.94 | 7.26 |

국내금리/채권

(%, bp)

| | Price | 1D | 1W | 1M | 3M | 1Y |
|--------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 한국 기준금리 (12/31) | 1.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 25.00 | 50.00 |
| CD(91일) (12/31) | 1.29 | 0.00 | 2.00 | 3.00 | 25.00 | 63.00 |
| LIBOR(3개월) (12/31) | 0.21 | -0.52 | -0.87 | 3.45 | 7.60 | -2.93 |
| 국고3년 (12/31) | 1.80 | -0.10 | 0.00 | -1.50 | 16.50 | 82.20 |
| 국고10년 (12/31) | 2.25 | 0.20 | 4.40 | 6.80 | -0.80 | 53.70 |
| 회사채3년(AA-) (12/31) | 2.42 | -0.20 | -2.30 | 3.00 | 32.80 | 20.70 |

해외 채권

(%, bp, 하이일드/리츠지수 변화율: %)

| | Price | 1D | 1W | 1M | 3M | 1Y |
|------------------------|----------|-------|-------|--------|--------|--------|
| 미국채 2년 (12/31) | 0.74 | 0.90 | 2.60 | 18.00 | 46.90 | 61.30 |
| 미국채 10년 (12/31) | 1.51 | 0.00 | 1.80 | 10.80 | 4.70 | 59.30 |
| 독일국채 10년 (12/31) | -0.18 | 0.00 | 7.30 | 16.60 | 4.70 | 39.20 |
| 일본국채 10년 (12/31) | 0.07 | 0.00 | 0.40 | 0.60 | 0.90 | 5.00 |
| 인도국채 10년 (12/31) | 6.45 | -1.50 | -1.00 | 10.20 | 20.80 | 58.90 |
| 중국국채 10년 (12/31) | 2.78 | 0.40 | -4.60 | -9.70 | -9.80 | -36.70 |
| 브라질국채 10년 (12/31) | 10.84 | 7.80 | 7.40 | -62.80 | -14.80 | 392.80 |
| 미국하이일드채권지수(p) (12/31) | 2,461.43 | -0.01 | 0.22 | 1.68 | 0.71 | 5.28 |
| FTSE글로벌리츠지수(p) (12/31) | 3,817.05 | 0.18 | 2.88 | 8.44 | 11.44 | 32.61 |

자료: 미래에셋증권 리서치센터

미국/유럽

(p, %)

| | Price | 1D | 1W | 1M | 3M | 1Y |
|---------------------|------------|-------|-------|--------|--------|--------|
| 미국 DowJones (12/31) | 36,338.30 | -0.16 | 1.08 | 6.81 | 5.86 | 18.73 |
| 미국 S&P500 (12/31) | 4,766.18 | -0.26 | 0.85 | 5.61 | 9.39 | 26.89 |
| 미국 NASDAQ (12/31) | 15,644.97 | -0.61 | -0.05 | 2.56 | 7.40 | 21.39 |
| 유로 STOXX50 (12/31) | 4,298.41 | -0.18 | 1.02 | 2.85 | 6.52 | 20.99 |
| 독일 DAX30 (12/30) | 15,884.86 | 0.21 | 0.82 | 5.20 | 4.81 | 15.79 |
| 영국 FTSE100 (12/31) | 7,384.54 | -0.25 | 0.17 | 3.01 | 5.09 | 14.30 |
| 브라질 보베스파 (12/30) | 104,822.40 | 0.69 | -0.07 | 2.85 | -7.15 | -11.93 |
| 러시아 RTS(\$) (12/30) | 1,595.76 | 0.38 | 0.50 | -3.04 | -9.92 | 15.01 |
| 필라델피아반도체 (12/31) | 3,952.04 | 0.00 | 0.50 | 3.71 | 21.18 | 41.97 |
| 나스닥헬스케어 (12/31) | 1,146.93 | -0.69 | -1.57 | 1.95 | -6.31 | -3.55 |
| VIX (12/31) | 17.22 | -0.63 | -4.12 | -44.67 | -18.58 | -24.31 |

에너지

(US\$, %)

| | Price | 1D | 1W | 1M | 3M | 1Y |
|--------------------|--------|-------|-------|--------|--------|--------|
| 원유 WTI (12/31) | 75.21 | -2.31 | 1.92 | 14.70 | -0.88 | 55.01 |
| 원유 Brent (12/31) | 77.78 | -1.94 | 2.15 | 12.94 | -1.89 | 50.15 |
| 원유 Dubai (12/31) | 76.48 | 0.07 | 3.18 | 9.35 | 1.06 | 52.26 |
| 휘발유 NYMEX (12/31) | 222.85 | -2.97 | 1.02 | 14.22 | -0.96 | 58.23 |
| 천연가스 NYMEX (12/31) | 3.73 | 4.75 | -0.03 | -12.40 | -33.62 | 46.91 |
| 석탄 ICE (12/31) | 137.55 | -0.33 | -3.13 | 11.74 | -40.98 | 99.35 |
| 플라스틱 (12/29) | 29.16 | 0.00 | 0.00 | -16.88 | -10.61 | 181.74 |
| 태양광 모듈 (12/29) | 0.21 | 0.00 | 0.00 | -4.17 | 1.47 | 22.49 |

금속

(US\$, %)

| | Price | 1D | 1W | 1M | 3M | 1Y |
|---------------------|----------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 철광석 DCE(위안) (12/31) | 684.00 | -0.29 | -2.22 | 14.00 | -4.34 | -36.61 |
| 중국 열연(위안) (12/31) | 4,749.00 | -0.08 | -1.74 | -0.02 | -18.13 | 3.80 |
| 구리 LME (12/31) | 9,682.00 | 0.26 | 1.21 | 1.81 | 6.38 | 24.82 |
| 알루미늄 LME (12/31) | 2,810.00 | -0.55 | -1.11 | 6.18 | -2.46 | 41.88 |
| 금 COMEX (12/31) | 1,828.60 | 0.80 | 0.96 | 2.64 | 4.08 | -3.51 |
| 은 COMEX (12/31) | 23.35 | 1.27 | 1.84 | 4.72 | 3.62 | -11.59 |

농산물/운송/반도체

(US\$, %)

| | Price | 1D | 1W | 1M | 3M | 1Y |
|-----------------------|----------|-------|-------|--------|--------|--------|
| 옥수수 CBOT (12/31) | 593.25 | -0.46 | -2.06 | 3.72 | 9.56 | 22.57 |
| 소맥 CBOT (12/31) | 770.75 | -1.15 | -5.40 | -1.00 | 2.05 | 20.34 |
| 대두 CBOT (12/31) | 1,328.75 | 0.08 | -0.24 | 8.18 | 6.60 | 1.03 |
| 설탕 ICE (12/31) | 18.88 | 0.53 | -1.87 | 1.51 | -5.88 | 21.89 |
| 천연고무 TOCOM(엔) (12/31) | 222.80 | 0.00 | 2.63 | -2.66 | 12.92 | -17.11 |
| BDI (p) (12/24) | 2,217.00 | -0.09 | -6.81 | -16.47 | -52.26 | 62.30 |
| SCFI (p) (12/31) | 5,046.66 | 1.83 | 1.83 | 9.66 | 9.37 | 81.34 |
| DDR4 8G (12/30) | 3.63 | 0.00 | 1.79 | 5.34 | -7.69 | 9.75 |
| NAND TLC 128G (12/30) | 1.99 | 0.00 | -0.05 | -0.10 | -3.35 | 20.75 |

금융시장 주요 지표 II

2022. 1. 3 (월)

| 유가증권시장 | | | 12/30 (목) | 12/29 (수) | 12/28 (화) | 12/27 (월) | 12/24 (금) |
|------------------------|----------|------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 가격 및 거래량 지표 | KOSPI | | 2,977.65 | 2,993.29 | 3,020.24 | 2,999.55 | 3,012.43 |
| | 이동평균 | 20일 | 2,995.09 | 2,993.48 | 2,988.80 | 2,979.74 | 2,975.22 |
| | | 60일 | 2,981.32 | 2,980.17 | 2,979.65 | 2,979.63 | 2,980.79 |
| | | 120일 | 3,078.72 | 3,081.29 | 3,083.89 | 3,086.16 | 3,088.51 |
| | 이격도 | 20일 | 99.42 | 99.99 | 101.05 | 100.66 | 101.25 |
| | | 60일 | 99.88 | 100.44 | 101.36 | 100.67 | 101.06 |
| | 거래대금(억원) | | 87,274.6 | 109,086.7 | 120,968.9 | 82,804.0 | 85,834.7 |
| 시장지표 | 투자심리도 | | 60 | 70 | 80 | 70 | 70 |
| | ADR | | 124.47 | 134.49 | 119.11 | 108.51 | 95.85 |
| 코스닥시장 | | | 12/30 (목) | 12/29 (수) | 12/28 (화) | 12/27 (월) | 12/24 (금) |
| 가격 및 거래량 지표 | KOSDAQ | | 1,033.98 | 1,028.05 | 1,027.44 | 1,011.36 | 1,007.42 |
| | 이동평균 | 20일 | 1,007.38 | 1,004.56 | 1,002.01 | 998.92 | 997.97 |
| | | 60일 | 1,001.77 | 999.91 | 998.70 | 997.96 | 997.82 |
| | | 120일 | 1,016.81 | 1,016.92 | 1,017.06 | 1,017.23 | 1,017.45 |
| | 이격도 | 20일 | 102.64 | 102.34 | 102.54 | 101.25 | 100.95 |
| | | 60일 | 103.22 | 102.81 | 102.88 | 101.34 | 100.96 |
| | 거래대금(억원) | | 101,026.1 | 116,836.1 | 132,431.0 | 100,446.2 | 108,664.4 |
| 시장지표 | 투자심리도 | | 80 | 80 | 80 | 70 | 60 |
| | ADR | | 114.40 | 118.10 | 107.86 | 100.08 | 95.85 |
| 자금지표 | | | 12/30 (목) | 12/29 (수) | 12/28 (화) | 12/27 (월) | 12/24 (금) |
| 국고채 수익률(3년, %) | | | 1.80 | 1.78 | 1.79 | 1.78 | 1.80 |
| AA- 회사채수익률(무보증3년, %) | | | 2.41 | 2.40 | 2.41 | 2.40 | 2.42 |
| 원/달러 환율(원) | | | 1,189.05 | 1,186.68 | 1,188.27 | 1,186.90 | 1,186.40 |
| 원/100엔 환율(원) | | | 1,033.61 | 1,030.87 | 1,034.77 | 1,032.86 | 1,037.50 |
| CALL금리(%) | | | - | 1.05 | 1.00 | 1.02 | 1.01 |
| 국내 주식형펀드 증감(억원, ETF제외) | | | - | 0 | 120 | -917 | -263 |
| 해외 주식형펀드 증감(억원, ETF제외) | | | - | 0 | -431 | 96 | -41 |
| 주식혼합형펀드 증감(억원) | | | - | 0 | -14 | -19 | -5 |
| 채권형펀드 증감(억원) | | | - | 0 | 1,741 | 1,216 | 1,733 |
| MMF 잔고(억원) | | | - | - | 1,540,623 | 1,535,511 | 1,553,949 |
| 고객예탁금(억원) | | | - | 680,015 | 662,010 | 644,713 | 627,758 |
| 미수금(억원) | | | - | 2,392 | 2,176 | 2,293 | 2,356 |
| 신용잔고(억원) | | | - | 231,488 | 230,934 | 231,325 | 231,686 |
| 해외 ETF 자금유출입 | | | 12/30 (목) | 12/29 (수) | 12/28 (화) | 12/27 (월) | 12/24 (금) |
| 한국 관련 ETF(억원) | | | - | - | - | - | -330.8 |
| 이머징 관련 ETF(억원) | | | - | 51.7 | -139.3 | 24.4 | -18.5 |
| 아시아 관련 ETF(억원) | | | 117.3 | 1.2 | 85.1 | 0.1 | -5.1 |
| 글로벌(선진) 관련 ETF(억원) | | | 159.0 | 346.1 | 126.4 | 2.7 | 0.2 |
| Total(억원) | | | 276.3 | 399.0 | 72.2 | 27.2 | -354.1 |

* 해외상장 ETF는 1) 미국, 유럽, 홍콩 시장에 상장된 한국 노출도가 있는 ETF를 모두 선별한 후, 2) 동 ETF들의 일간 자금유입액 중에서 한국의 비중을 계산하여 총합한 액수.

추종 인덱스의 리밸런싱은 분기별로 이뤄지나 비중은 지수 레벨에 따라 달라질 수 있어 대략적인 추정치로 계산할 것이기 때문에 100% 정확하지 않음