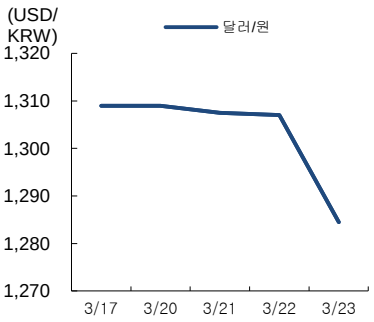
Daily

외환/금리스왑 동향 및 전망

2023-03-24

외환시장



딜러 전망치	예상레인지	
	저점	고점
원달러	1280	1292
엔달러	129.80	131.50
원엔	973	995
달러유로	1.0750	1.0950
원유로	1376	1415

전일 동향

Seoul 전일 종가 대비 9.7원 하락한 1,298.0원에 개장한 달러원 환율은 FOMC에서 비둘기파적인 모습을 나타내자 급락세를 보임. 달러화 약세 흐름 속에 역외 매도세가 집중되자 달러원은 전일 종가 대비 29.4원 하락한 1,278.3원에 마감하며 한달래 최저치를 기록함.

금일 전망

달러/원 전일 달러원 환율은 전일 급락에 따른 회복세가 소폭 나타나며 전일 종가 대비 7.4원 상승한 현물환 기준 1,287.5원에 NDF 거래를 마감함. 금일 서울외환시장에서 달러원 환율은 장중 코스피 움직임에 주목하는 가운데 강보합권에 머무를 것으로 예상됨. 그러나 분기말이 다가옴에 따른 네고물량이 상단을 제한할 것으로 보임.

예상범위 : 1,280~ 1,292원

달러/엔 전일 엔화는 미국 FOMC에서 연준이 25bp 금리 인상을 단행하였으나, 지속적 인상이라는 문구를 성명서에서 삭제함에 따라 강세 흐름을 이어감. 미국 10년물 국채수익률도 하락 흐름을 이어가고 있어 엔화 강세를 지지. 금일 엔화는 여전히 불안한 리스크 선호심리에 강세 흐름 이어갈 것으로 예상됨.

달러/엔 예상범위 : 129.8~131.5엔 | 엔/원(100) 예상범위 : 973~995원

유로/달러 전일 유로화는 미국 연준이 FOMC에서 다소 비둘기파적인 태도를 보였지만, ECB는 매파적 태도를 유지하며 큰 폭의 강세를 이어가다 미국장 개장 이후 그 동안의 강세가 다소 과하다는 인식에 약세로 전환하는 모습. 금일 유로화는 주식시장이 안정화되고 있고 은행 위기가 안정된다면 연준과 ECB 정책 차별화에 강세흐름 이어갈 것으로 예상.

유로/달러 예상범위 : 1.075~1.095 달러 | 유로/원 예상범위 : 1,376~1,415원

스왑시장

금리 스왑(IRS) 동향 및 전망

전일 전일 IRS 금리는 완화적이었던 미 FOMC 결과로 미국금리가 하락한 것을 반영하며 하락하며 출발함. 기준금리를 25bp 인상하였으나, 향후 인하 기대감으로 완화적으로 해석됨. 외국인은 국채선물 매수세를 이어갔고, 오퍼 우위의 시장 지속되면서 전일 대비 하락 마감함.

금일 금일 IRS 금리는 국내 재료의 부재 속에 대외 금리 흐름에 따라 변동을 보일 듯. 여전히 금융 불안이 해소되지 않은 상황이라 하락 압력이 소폭 우세할 것으로 보임. 다만, 국내는 레벨 부담감으로 추가로 하락은 제한적일 것으로 판단됨.

통화 스왑(CRS) 동향 및 전망

전일 전일 CRS 금리는 완화적인 FOMC 결과로 글로벌 금리 및 원화 금리 하락에 연동되며 하락하는 모습을 보였음. 또한, 금융불안 리스크도 지속되면서 오퍼가 우위를 보였음. 전일 대비 하락 마감함.

금일 금일 CRS 금리는 FOMC 이후 대외 금리 흐름과 원화 금리 방향에 연동되는 모습을 보일 듯. 다만 여전히 금융불안이 해소되지 않고 있기 때문에, 오퍼 우위의 모습은 이어질 것으로 판단됨.

서울 외환시장

(단위 : 원)

구분	달러/원	위안/원
시가	1,298.00	189.53
고가	1,300.20	189.53
저가	1,276.50	186.80
종가	1,278.30	187.67
전일비	-29.40	-2.16
평균환율	1,287.20	187.39
NDF(1M)	1,281.30	
거래량	125(억불)	116(억위안)

주요 통화 환율

통화	환율	전일비
USD/KRW	1,278.30	-29.40
JPY/KRW	977.37	-10.13
EUR/KRW	1,393.99	-14.80
GBP/KRW	1,575.57	-23.62
AUD/KRW	861.00	-14.64
XAU/KRW	81,456.85	-161.02
USD/JPY	130.81	-0.63
EUR/USD	1.0830	-0.0025

금리 장외파생상품 (원화)

(단위 : %)

만기	IRS	전일비	CRS[1)]	전일비
1Y	3.5400	-0.02	2.5000	-0.11
2Y	3.2700	-0.07	2.4300	-0.02
3Y	3.1525	-0.06	2.4600	-0.03
4Y	3.0975	-0.04	2.4300	-0.03
5Y	3.0600	-0.03	2.4400	-0.05
7Y	3.0350	-0.01	2.3800	-0.05
10Y	3.0300	+0.00	2.3500	-0.05

1) 3개월 주기로 무위험지표 복리평균금리(Compounded SOFR) 3개월물과 교환되는 원화 고정금리

기준 금리 및 채권금리 (원화)

구분	종가	전일비
CD 91일물	3.62	+0.00
통안 1년	3.333	+0.01
통안 2년	3.315	-0.05
국고채 3년	3.206	-0.08
국고채 5년	3.186	-0.08
국고채 10년	3.266	-0.02
국고채선물(3년)	105.14	+0.15

단기 FX Swap Point (원화)

(단위 : 전)

만기	SWAP Point	전일비	Implied CRS
1M	-265	-10	2.42%
3M	-730	+0	2.65%
6M	-1,400	+60	2.63%
1Y	-2,570	+90	2.53%

금리 장외파생상품 (미국)

(단위 : %)

만기	국채	전일비	IRS[2)]	전일비
1Y	4.356	-0.13	4.467	-0.14
2Y	3.823	-0.14	3.809	-0.14
3Y	3.615	-0.13	3.474	-0.19
5Y	3.430	-0.10	3.239	-0.09
10Y	3.412	-0.04	3.128	-0.05

2) 1년 주기로 무위험지표 복리평균금리(Compounded SOFR) 1년물과 교환되는 달러 고정금리

주요 증시

증시	종가	전일비	
KOSPI	2,424.48	+7.52	+0.31%
미국 DOW	32,105.25	+75.14	+0.23%
중국 상해종합	3,286.65	+20.90	+0.64%
일본 NIKKEI 225	27,419.61	-47.00	-0.17%
영국 FTSE 100	7,499.60	-67.24	-0.89%

기타

종목	종가	전일비
WTI (선물)	69.48	-0.58
금 (선물)	1,994.60	+25.10
3M $ LIBOR	5.08000	+0.06229
3M EURIBOR	3.00200	+0.09400
KOR 5Y CDS	43.23	-1.27

· 본 자료는 자료 제공일 현재 시점에서의 의견 및 추정치로서 실적치와 오차가 발생할 수 있으며 투자를 유도할 목적이 아니라 고객의 투자 판단에 참고가 되는 정보 제공을 목적으로 하고 있습니다. 따라서 모든 매매는 본인의 책임하에 진행되어야 함을 유념하시기 바랍니다. 또한 본 자료는 당행 고객에 한하여 배포되는 자료로 어떠한 경우에도 당행의 허락 없이 복사, 대여, 재배포 될 수 없습니다.