우리은행 WOORI BANK

Daily Forex Live

2023.6.9(금)

FOMC 대세론 교체, 1,290원대 안착 시도

FX Economist 민경원
eco_min1230@wooribank.com
FX Sales & Marketer 신승연
syshin@wooribank.com

금일 달러/원 예상: 1,291~1,301원
NDF 종가: 1,294.70(스왑포인트 -2.10 고려 시 1,296.80원 전일비 -6.90)
시장평균환율(MAR): 1,306.10원

NDF 최종호가	저가	고가
1,294.60/1,294.80	-	-

금일 전망: 달러 약세에 위험선호 회복까지, 1,290원대 안착 시도

상승요인: 수입업체 결제를 비롯한 역내 달러 실수요 주체 저가매수 유입
하락요인: 달러화 약세, 성장주 리스크 온, 역내 수출업체 네고 물량 소화

오늘 달러/원은 FOMC 동결 대세론 부상에 따른 달러화 약세, 성장주 랠리에 편승해 1,290원대 안착 시도 예상. 주간 신규 실업수당 청구건수가 예상을 웃돌면서 연준이 다음 주 추가적인 긴축 조치 없이 FOMC를 마무리할 것이라는 쪽으로 시장 중론이 변경. 이에 달러가 크게 하락하고 기술주가 랠리를 보이면서 오늘 코스피를 비롯한 아시아 증시도 상승폭을 확대할 것으로 기대. 여기에 최근 적극적인 매도대응을 보여주고 있는 수출 및 중공업체 네고 물량이 더해지면서 오늘 장중 하락압력 우위에 일조할 듯.

다만 수입 결제를 비롯한 저가매수는 하단을 지지. 이틀 전 환율 하락 시점에서도 역내 달러 실수요 주체가 공격적인 매수대응으로 일관하면 1,300원 하향이탈을 방어. 오늘도 장 갭다운 출발 후 저가매수가 따라 붙으며 하락 속도를 조절할 가능성이 농후 따라서 오늘 10원 가까이 하락 출발 후 증시 외국인 순매수, 역내외 매도 우위에 하락압력이 우위를 보이겠으나 결제수요가 하단을 지지하며 1,290원 중후반 중심 등락 전망.

전일 동향: 수급 부담 속 위안화 강세전환, 코스피 낙폭 축소에 보합

전일 달러/원은 1,303.7(-0.1)원. 1,307.6원에 출발한 환율은 장 초반부터 수출네고 물량을 소화하며 추가 상승이 제한되었으나 1,300원 후반 레벨은 유지. 이후 오후 두시부터 코스피가 낙폭을 줄이고 위안화도 강세로 돌아서자 오전에 새롭게 포지션을 구축했던 역외 롱스탑까지 따라 붙으며 전일대비 보합 마감.

글로벌 동향: 달러, 6월 FOMC 동결 기대에 국채금리와 동반 하락

달러지수: 103.343(-0.756), 유로/달러 1.0782(+0.0083), 달러/엔 138.92(-1.21)
달러화는 실업지표 부진이 다음주 금리동결 기대를 자극한 영향에 큰 폭 하락 마감.

미국 주간 신규 실업수당 청구건수는 26.1만명으로 예상(23.5만명)을 상회. 이에 다음주 FOMC가 매파적 동결로 마무리될 것이란 해석이 대세론으로 떠올랐고, 미국 2년과 10년 국채금리는 큰 폭으로 하락. 엔화는 금리 하락을 쫓아 약 0.9% 급등.

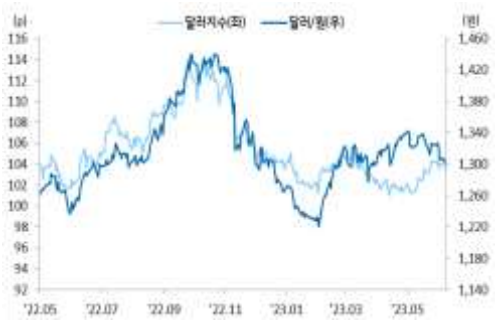
뉴욕증시는 6월 FOMC 동결 대세론이 금리 하락, 밸류에이션 부담 완화로 연결되며 기술두를 필두로 상승. 호주 달러는 국제유가가 장중 일시적으로 배럴당 70달러를 하회하며 약세를 보였음에도 위험선호 분위기 개선에 상승.

유로화는 1분기 GDP가 전분기대비 0.1% 하락해 2분기 연속 마이너스 성장을 기록했음에도 ECB 금리인상 기대에 상승. 연준 매파적 동결과 달리 ECB가 당장 다음 주 추가 금리인상에 나설 것이란 기대는 견고.

오늘 외환시장 주요 이벤트

10:30 중국 5월 CPI YoY(예상 0.2%, 이전 0.1%)
10:30 중국 5월 PPI YoY(예상 -4.3%, 이전 -3.6%)
17:00 유로 귄도스 ECB 부총재 연설
19:45 유로 콘테노 포르투갈 중앙은행 총재 연설

달러/원, 달러지수(vs G10)



달러/원 리스크 리버설 급락, 옵션시장 원화 강세 배팅 확대

주간 실업지표 부진에 미국 국채금리와 달러화 동반 급락

출처: 연합인포맥스, Bloomberg, 우리은행 트레이딩부

전일 SPOT 종가

(단위: 원, 억달러)

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비
USD/KRW	1,303.70	(0.10)	1,307.60	1,308.40	1,302.80	5.60	102.75	(22.73)
JPY/KRW	931.48	(4.53)	931.82	937.88	931.42	6.46	-	-
EUR/KRW	1,396.07	3.93	1,395.94	1,404.89	1,395.19	9.70	-	-
CNH/KRW	182.44	(0.30)	182.35	183.58	182.26	1.32	-	-

출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

주요통화 환율

종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	103.343	(0.756)	(0.21)
EUR/USD	1.0782	0.0083	0.19
USD/JPY	138.92	(1.21)	0.09
GBP/USD	1.2560	0.0122	0.27
USD/CNH	7.1209	(0.0268)	0.23
USD/CHF	0.8990	(0.0111)	(0.72)
AUD/USD	0.6716	0.0064	2.21
NZD/USD	0.6095	0.0058	0.40
USD/CAD	1.3357	(0.0013)	(0.68)

아시아/신흥국 통화 환율

종목	종가	전일비	1주(%)
USD/KRW	1,303.70	(0.10)	(1.35)
USD/SGD	1.3427	(0.0061)	(0.38)
USD/IDR	14895	17	-
USD/PHP	56.12	0.02	(0.27)
USD/RUB	82.5866	0.7372	1.96
USD/ZAR	18.8357	(0.2561)	(4.03)
USD/MXN	17.3806	0.0161	(0.97)
USD/PLN	4.1480	(0.0453)	(1.22)
USD/TRY	23.1245	(0.1239)	11.13

출처: 블룸버그, 우리은행 트레이딩부 / 주: 뉴욕시장 종가 기준(한국시간 06:00)

FX SWAP POINT

(단위: 원)

만기	Mid	전일비
1M	(2.10)	0.00
2M	(4.55)	(0.15)
3M	(7.10)	0.15
6M	(15.00)	(0.10)
12M	(29.60)	(0.30)

한국 CDS Premium

(단위: bp)

만기	Mid	전일비
5Y	37.075	0.090

IRS(vs 3M CD)

(단위: %, bp)

만기	Offer	Bid	Mid	전일비
1Y	3.775	3.745	3.760	4.25
2Y	3.590	3.560	3.575	5.75
3Y	3.475	3.445	3.460	7.50
4Y	3.415	3.385	3.400	7.50
5Y	3.375	3.345	3.360	7.50

한국/미국(SOFR) 단기금리

(단위: %, bp)

한국	종가	전일비	미국	종가	전일비
기준	3.50	0.00	기준	5.25	0.00
RP(7일)	3.70	0.00	1M	5.1464	1.52
CD	3.75	0.00	3M	5.2506	1.25
통안3M	3.524	1.80	6M	5.2921	1.42
통안1Y	3.545	2.00	12M	5.1462	4.24

CRS(vs 3M SOFR)

(단위: %, bp)

만기	Offer	Bid	Mid	전일비
1Y	3.139	2.531	2.835	5.00
2Y	3.016	2.414	2.715	3.50
3Y	3.006	2.404	2.705	3.50
4Y	3.016	2.414	2.715	3.50
5Y	3.041	2.439	2.740	4.00

출처: Bloomberg, 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

국내시장 동향

(단위: p, %, bp)

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,610.85	(4.75)
KOSDAQ	876.13	(4.59)
국고채3Y	3.543	7.20
국고채10Y	3.632	11.00

외국인 증권투자 동향

(단위: 억원)

종목	외인 순매수	5일누적
KOSPI	(3,833)	(679)
KOSDAQ	(2,224)	(144)
국고채	7,676	13,469
통안채	(1,982)	2,285

출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

글로벌 금융시장

(단위: p, %, bp, 달러, 달러/톤)

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)	종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
Dow Jones	33,833.61	168.59	0.50	2.34	미국채 2Y	4.5147	(4.16)	(0.91)	4.01
S&P	4,293.93	26.41	0.62	1.73	미국채 10Y	3.7179	(7.73)	(2.04)	3.42
NASDAQ	13,238.52	133.63	1.02	1.05	WTI	71.29	(1.24)	(1.71)	1.70
EuroStoxx 50	4,297.68	5.77	0.13	0.94	Brent	75.96	(0.99)	(1.29)	2.26
DAX 30	15,989.96	29.40	0.18	0.86	구리	8,347.50	54.00	0.65	1.26
Nikkei225	31,641.27	(272.47)	(0.85)	1.58	니켈	21,132.00	(285.00)	(1.33)	(0.87)
Shanghai	3,213.59	15.83	0.49	0.28	대두	1,363.25	2.50	0.18	2.54
Hang Seng H	6,540.03	(1.13)	(0.02)	6.35	Gold	1,963.60	20.90	1.08	(0.73)

출처: 인포맥스, Bloomberg, 우리은행 트레이딩부

경제지표 및 이벤트

전일	금일	익일
08:50 일본 1Q GDP QoQ(F)(0.7%, 예상 0.5% 상회)	10:30 중국 5월 CPI YoY(예상 0.2%, 이전 0.1%)	
10:30 호주 4월 무역수지(A$11,158m, 예상 A$13,650m 하회)	10:30 중국 5월 PPI YoY(예상 -4.3%, 이전 -3.6%)	
18:00 유로 1Q GDP QoQ(F)(-0.1%, 예상 0.0% 하회)	17:00 유로 귄도스 ECB 부총재 연설	
21:30 미국 주간 신규실업수당청구(261k, 예상 235k 상회)	19:45 유로 콘테노 포르투갈 중앙은행 총재 연설	

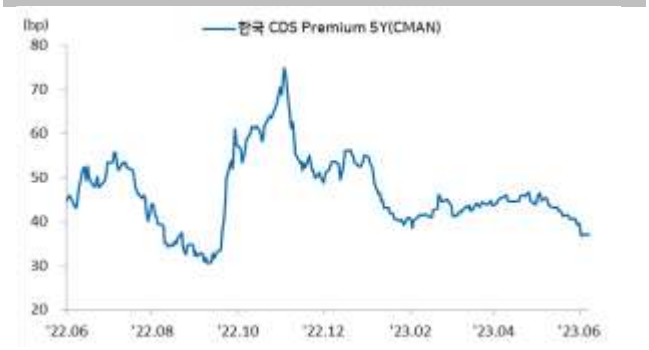
주석: (A)-예비치, (P)-잠정치, (F)-확정치

Chart

FX Swap Point

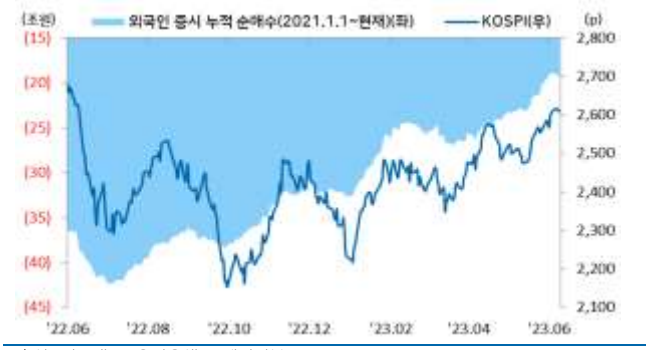
출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

CDS Premium



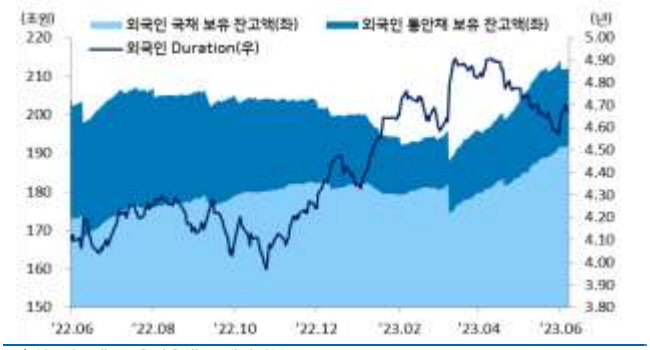
출처: Bloomberg, 우리은행 트레이딩부

KOSPI 지수, 외국인 순매수 동향



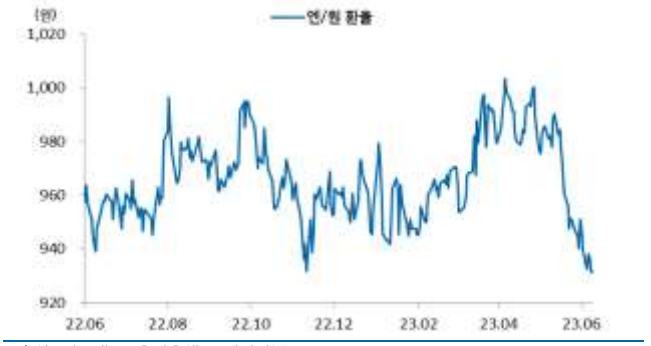
출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

국내 채권시장 외국인 보유잔고 및 듀레이션



출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

엔/원 환율



출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

국제유가 및 투기적 포지션 동향

출처: Bloomberg, 우리은행 트레이딩부

일간 주요통화 달러대비 절상(절하)율

출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부 / 주: 뉴욕환시 종가 기준

일간 신흥국, 아시아통화 달러대비 절상(절하)율

출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부 / 주: 뉴욕환시 종가 기준

Compliance Notice

본 자료에 기재된 내용들은 작성자 본인의 의견을 정확하게 반영하고 있으며 외부의 부당한 압력이나 간섭 없이 작성되었음을 확인합니다(작성자: 민경원).

본 자료는 고객의 투자를 돕기 위한 목적으로 작성되었습니다. 본 자료에 수록된 내용은 당행이 신뢰할 만한 자료 및 정보를 바탕으로 작성한 것이나, 당행이 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없으므로 참고 자료로만 활용하시기 바라며 투자 시 투자자 자신의 판단과 책임하에 최종 결정을 하시길 바랍니다. 따라서 본 자료는 어떠한 경우에도 고객의 투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙자료로 사용될 수 없으며 직간접적 손실이 발생해도 당행은 책임을 지지 않습니다.

본 자료는 자본시장법 상 조사분석자료가 아니며 조사분석의 독립성을 확보하기 위한 법적 제한을 받지 않습니다. 또한 법령 상 허용되는 범위 내에서 당행이 본 자료에 언급된 통화 및 관련 금융상품 등을 거래하거나 관련 금융서비스를 제공할 수 있으며 이와 관련해 당행이 이해관계를 가질 수 있습니다.

본 자료에 기재된 의견은 예측에 불과하며 별도 통지 없이 변경될 수 있고 일정한 주기로 업데이트 되지 않을 수 있습니다.

본 자료는 어떠한 경우에도 당행의 사전동의 없이 복사, 인용, 배포, 전송, 대여 및 변경될 수 없습니다