DGB 일일 외환시장 동향 및 전망

DGB Daegu Bank

1. 전일 주요시장지표

09.JUN.2023

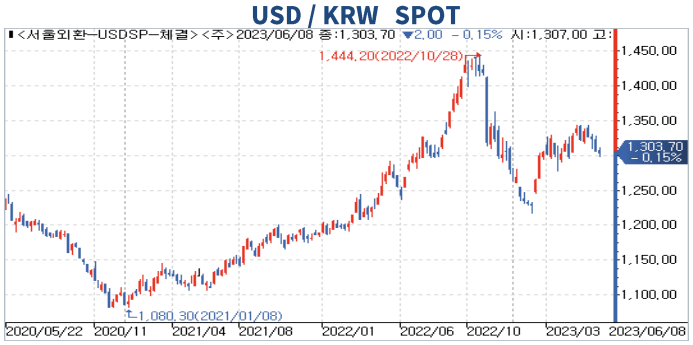
	LOW	HIGH	CLOSE	최초고시	INDEX	CLOSE	CHANGE	INDEX	CLOSE	CHANGE
USD/KRW	1302.8	1308.4	1303.7	1306.10	3M CD	3.75	+0.000	DOW	33833.61	+168.59
USD/JPY	138.80	140.23	138.92	940.69	3Y 국고채	3.547	+0.070	Nasdaq	13238.52	+133.62
EUR/USD	1.0694	1.0787	1.0782	1408.50	3M LIBOR	5.540	+0.030	Gold($)	1965.34	+25.32
USD/CNY	7.1164	7.1551	7.1194	182.72	10Y 미국채	3.7199	-0.077	WTI($)	71.29	-1.24

2. FX Market

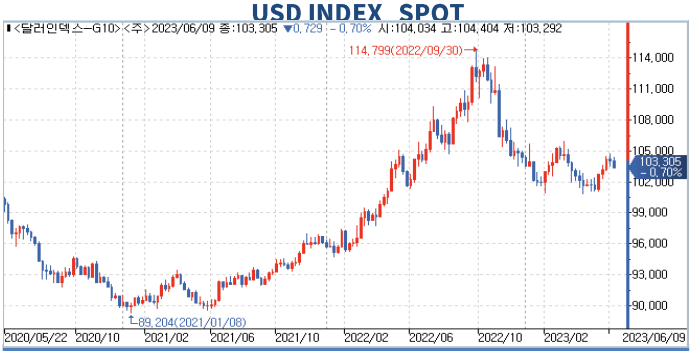
금 일 예 상	거 래 범 위		3일최저	3일최고
USD/KRW	1292.0	1302.0	1296.8	1311.0
JPY/KRW	930.0	938.0	929.4	940.4
EUR/KRW	1395.0	1495.0	1387.9	1406.2

금 일 예 상	거 래 범 위		3일최저	3일최고
USD/JPY	137.89	140.74	139.99	140.24
EUR/USD	1.0661	1.0847	1.0666	1.0787
USD/CNY	7.0916	7.1690	7.1055	7.1551

USD / KRW SPOT



USD INDEX SPOT



전 일 서 울 외 환 시 장 종 합

전일 외환시장에서 달러원 환율은 캐나다 중앙은행 금리 인상을 소화하며 상승 출발 한 후 장중 네고 물량 등에 전 거래일 대비 0.10원 하락한 1,303.70원에 거래를 마감함.
장초반 달러원 달러원 환율은 연준의 통화정책 불확실성 확대에 위험선호 회피 영향으로 1,307.60원에서 상승 출발 하였음.
개장 후 1,300원 중후반대에서 레인지를 형성하던 달러원 환율은 달러 인덱스 약세와 위험선호 심리 회복에 낙폭을 확대 하였음.
이후 코스피가 낙폭을 일부 되돌리고 달러위안 약세에 연동하여 달러원 환율은 하락세를 보였고, 오후 들어 1,300원 초반대에서 횡보장을 보이다 1,303.70원에 종가를 형성함.

거래 범위 : 1,302.80 ~ 1,308.40

역외 차액결제선물환(NDF) 시장에서 달러-원 1개월물은 글로벌 달러화가 약세를 보이며 1,294.70원에 최종 호가됨.
최근 1개월물 스와프포인트(-2.05원)을 고려하면 전 거래일 서울외환시장 종가 대비 6.95원 하락함.

국 제 금 융 시 장 종 합

미증시는 기술주 강세 지속으로 상승 마감. 다음주 FOMC를 앞두고 있는 재료부재 속에서 전일의 하락세를 이어갈 것으로 예상됐으나 S&P500지수 기준 작년 10월 저점대비 20% 이상 상승하며 연고점으로 마감. 가계 소비가 경기를 뒷받침하며 침체 없는 상승세가 이어지고 있음.

미국채수익률은 주간실업자수 증가로 고용시장 둔화를 반영하며 하락. 2년물은 4.54%, 10년은 3.72% 역전폭은 -82bp. 전일 캐나다 중앙은행의 깜짝 인상으로 7월 인상론이 부각되었으나 하루만에 하락 전환.

전일 주간실업청구건수가 26.1만명으로 3주연속 증가한 영향이 채권수익률 하락과 결부되어 달러 강세 흐름을 제한하였음. 유로화가 급반등하며 1.08선에 근접하였고 달러 대 엔화도 139엔선을 하회하였음.

달 러 / 원 금 일 예 상

◎ 금일 서울외환시장은 역외 차액결제선물환(NDF) 환율을 반영해 1,297.00원선에서 개장할 것으로 보임. 전일 뉴욕증시는 다음주 예정된 FOMC를 앞두고 관망세가 이어지는 분위기 속에 기술주 주도로 3대 지수 상승 마감하였음. 이번달 FOMC에서 연준의 기준금리 동결을 예상하는 분위기가 확대되며 글로벌 달러화는 약세를 보였음. 금일 달러원 환율은 간밤 글로벌 달러화 약세를 반영하고 장중 중국의 CPI와 PPI 발표를 소화하며 1,290원 후반대에서 등락을 보일 것으로 예상됨.

3. Derivatives

USD/KRW 선물환 스왑포인트 (단위:원)

만기	1개월	3개월	6개월	12개월
매입율	-3.10	-9.60	-19.00	-37.60
매도율	-1.10	-4.60	-11.00	-21.60

IRS(원화이자율스왑) CRS(USD/KRW통화스왑)

만기	1년	2년	3년	5년
IRS	3.7600	3.5750	3.4600	3.3600
CRS	3.2350	3.1250	3.1250	3.1650

본 자료는 참고자료로만 사용가능하며 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없으며 은행의 공식 입장은 아님을 유념하시기 바랍니다.
또한 본 자료는 당행의 허락 없이 복사, 대여, 재배포 될 수 없습니다.

• 자금운용부 FX DESK ☎ 82-2-752-2897 / 82-2-772-9698