# DGB 일일 외환시장 동향 및 전망

DGB Daegu Bank

## 1. 전일 주요시장지표

27.JAN.2021

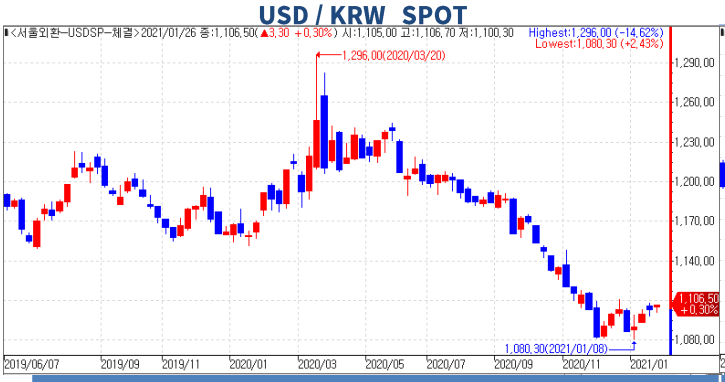
| | LOW | HIGH | CLOSE | 최초고시 | INDEX | CLOSE | CHANGE | INDEX | CLOSE | CHANGE |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| USD/KRW | 1100.5 | 1106.7 | 1106.5 | 1103.00 | 3M CD | 0.69 | +0.000 | DOW | 30937.04 | -22.96 |
| USD/JPY | 103.52 | 103.83 | 103.61 | 1064.36 | 3Y 국고채 | 1.002 | -0.003 | Nasdaq | 13626.06 | -9.93 |
| EUR/USD | 1.2106 | 1.2176 | 1.2168 | 1341.41 | 3M LIBOR | 0.219 | +0.006 | Gold($) | 1851.39 | -4.49 |
| USD/CNY | 6.4684 | 6.4903 | 6.4713 | 170.10 | 10Y 미국채 | 1.0406 | +0.008 | WTI($) | 52.61 | -0.16 |

## 2. FX Market

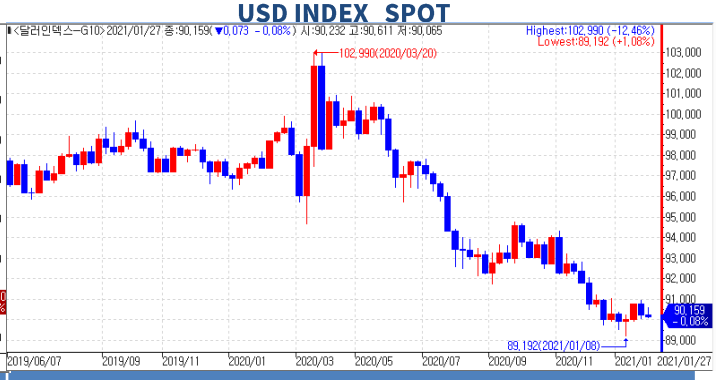
| 금 일 예 상 거 래 범 위 | | | 3일최저 | 3일최고 |
|---|---|---|---|---|
| USD/KRW | 1,100.0 | 1,106.0 | 1100.3 | 1106.7 |
| JPY/KRW | 1,061.0 | 1,068.0 | 1058.6 | 1068.5 |
| EUR/KRW | 1,338.0 | 1,343.0 | 1333.4 | 1347.3 |

| 금 일 예 상 거 래 범 위 | | | 3일최저 | 3일최고 |
|---|---|---|---|---|
| USD/JPY | 103.35 | 103.96 | 103.83 | 103.94 |
| EUR/USD | 1.2080 | 1.2220 | 1.2106 | 1.2189 |
| USD/CNY | 6.4548 | 6.4986 | 6.4619 | 6.4989 |

USD / KRW SPOT




USD INDEX SPOT




### 전 일 서 울 외 환 시 장 종 합

전일 서울외환시장에서 달러-원 환율은 코스피 부진 및 글로벌 달러 약세 속 역외 매수세가 강해지며 전 거래일 대비 5.80원 하락한 1,106.50원에서 거래를 마감함.

달러화는 코로나 바이러스 재확산을 막기 위한 주요국 봉쇄가 강화된 영향에 1,102원선에서 상승 출발해 장 초반 수출업체 네고물량이 유입되며 1,100.50원까지 저점을 낮췄으나 저가 매수세에 하단이 지지됨. 이후 코스피가 낙폭을 확대하는 등 안전 자산 선호가 강해진 가운데 글로벌 달러 강세에 연동하며 1,100원 중반대에 안착함. 장 후반엔 역외 중심의 달러 매수, 숏 커버가 나오며 1,106.70원까지 고점을 높힌 뒤 그 부근에서 종가를 형성함.

거래범위 1,100.50 ~ 1,106.70

역외 차액결제선물환(NDF) 시장에서 달러원 1개월물은 글로벌 달러 약세에 1,102.30원에 최종 호가됨. 최근 1개월물 스와프포인트(0.10원)을 고려하면 전 거래일 서울외환시장 종가 대비 4.30원 하락함.

### 국 제 금 융 시 장 종 합

전일 미증시는 우량주 위주로 상승세를 이어갔으나 막판 FOMC경계감 및 실적 관련 불확실성 확산으로 차익매물 출회되며 3대지수 모두 소폭 하락 마감하였음. 기술주의 호실적 기대감에도 불구 고점논란은 현재 진행형임.

미국채 10년 수익률은 전일과 큰 변동 없는 1.035%로 마감. 기대인플레이션 상승 속에 연준위원들의 인플레에 관한 해석이 각양각색을 것으로 보여 시장은 FOMC결과와 문구 변화여부를 주목하고 있음.

전일 글로벌 달러화는 강세와 약세를 매일 반복하고 있음. 전반적인 위험경계가 확산되고 있으나 전일 급락하였던 이머징 통화 및 상품통화가 직전저가를 하향하지 못하고 상승반전함에 따라 달러화 약세로 이어짐. 유로화와 엔화는 FOMC를 앞두고 큰 변화 없었음.

### 달러/원 금일 예상

◎ 금일 서울외환시장은 역외 차액결제선물환(NDF) 환율을 반영해 1,102원선에서 개장할 것으로 보임.
◎ 글로벌 달러 약세를 쫓아 달러화는 하락 압력이 우세할 것으로 전망. 또한 수출업체 네고물량, 롱 스톱이 나올 수 있다는 점도 하락 요인이나 FOMC를 앞둔 경계 속 실수요성 매수세에 하단은 지지될 것으로 보여 1,100원 초중반대 중심에서 제한적 하락 시도가 예상됨. 역내 수급, 역외 달러-위안 환율 및 주요 아시아 증시 추이에 주목해야 할 것으로 보임.

## 3. Derivatives

USD/KRW 선물환 스왑포인트 (단위:원)

| 만기 | 1개월 | 3개월 | 6개월 | 12개월 |
|---|---|---|---|---|
| 매입율 | -0.40 | -2.30 | -3.40 | -4.30 |
| 매도율 | 0.60 | 2.10 | 2.60 | 2.70 |

IRS(원화이자율스왑) CRS(USD/KRW통화스왑)

| 만기 | 1년 | 2년 | 3년 | 5년 |
|---|---|---|---|---|
| IRS | 0.7850 | 0.9025 | 1.0100 | 1.1775 |
| CRS | 0.1350 | 0.1600 | 0.1950 | 0.3100 |

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