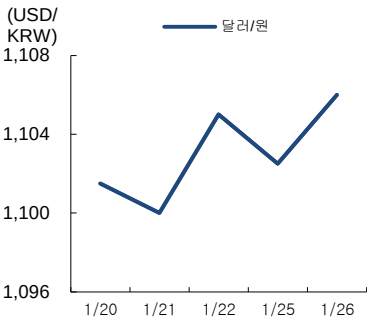
Daily

외환/금리스왑 동향 및 전망

2021-01-27

외환시장



딜러 전망치	예상레인지	
	저점	고점
원달러	1098	1106
엔달러	103.0	104.0
원엔	1056	1074
달러유로	1.210	1.223
원유로	1329	1353

전일 동향

Seoul 달러원은 1102.5원 개장 후 오전 중 코스피가 약세를 보였으나 주요 통화들이 달러 약세 움직임을 보이자 연동해 하락하면서 1100.5원에 저점을 보였음. 오후장 들어 코스피가 지속적으로 약세를 보이는 가운데 외국인 투자자들이 주식 매도에 나서며 반등하여 1106.7원에 고점을 보이고 1106.5원에 마감. 외국인 투자자의 주식 매도액은 2조원을 상회하였음. 뉴욕 NDF 는 4원 이상 하락한 1102.3원(스팟 1102.2원)에 마감.

금일 전망

원/달러 뉴욕 시장에서 달러원은 위안화가 강세를 보이자 연동하여 하락하였음. 아직 1100원 언저리 중심의 레인지 장세를 깰만한 소재가 뚜렷하지 않은 가운데 월말 장으로 들어가면서 네고 유입으로 인해 조금씩 하락 압력을 받을 수 있음. 전일 외국인이 주식을 2조원 이상 매도하여 1100원 밑에서는 역송금 기반 결제 수요 예상됨.

예상범위 : 1,098~1,106원

엔/달러 전일 엔화는 미국 재정부양책에 대한 혼재 된 발언들이 이어지고 미국 국채 10년물 수익률이 하향세를 이어가며 엔 캐리트레이드 매력 감소로 지속적 강세를 보임. 금일 엔화는 FOMC 회의 결과를 기다리며 연준이 기존 완화 기조를 이어가고 조기 테이퍼링에 대한 우려를 불식시킨다면 강세 이어갈 것으로 전망.

엔/달러 예상범위 : 103.0~104.0엔 | 원/엔(100) 예상범위 : 1,056~1,074원

달러/유로 전일 유로화는 아시아장에서 리스크 회피심리로 증시가 하락세를 보이며 약세 보였으나 이후 미국 재정부양책에 대한 혼재 된 발언들이 이어지고 IMF에서 세계경제 성장률 전망치를 상향 조정하며 강세 보임. 금일 유로화는 FOMC회의를 대기하며 조기 테이퍼링에 대한 언급에 주목하며 기존의 강세 기조 이어갈 것으로 전망.

달러/유로 예상범위 : 1.210~1.223달러 | 원/유로 예상범위 : 1,329~1,353원

스왑시장

금리 스왑(IRS) 동향 및 전망

전일 전일 IRS 금리는 위험 자산 선호 심리 후퇴로 소폭 하락 마감함. 미국 금리 영향으로 강 보합권에서 출발한 국내 채권 금리는 오후 들어 증시 하락과 환율 상승 등 위험 자산 선호 심리 후퇴하며 강세 마감함. IRS 금리는 상대적으로 비드 물량이 우위를 보이며 본드 스왑 스프레드는 확대 마감함.

금일 금일 IRS 금리는 안전 자산 선호 심리 우위로 하방 압력이 우위를 보일 것으로 전망. 다만 국고채 공급 부담감과 FOMC 경계감으로 추가 하락 제한되며 장,단기 수익률 스프레드는 축소 압력이 우세 할 것으로 판단.

통화 스왑(CRS) 동향 및 전망

전일 전일 CRS 금리는 위험 자산 선호 심리 후퇴와 중공업 물량 유입으로 하락 마감함. 2~3년 구간 중공업 물량 유입되며 하락 출발한 CRS 금리는 안전 자산 선호 심리 우위로 해당 구간 낙폭 확대되며 마감함.

금일 금일 CRS 금리는 에셋 스왑 및 중공업 선물환 물량 우위 흐름 지속되며 하방 압력이 우위를 보일 것으로 전망. 다만 최근 금리 하락에 따른 대기 매수세 유입으로 추가 하락 제한되며 장,단기 수익률 스프레드는 확대 압력이 우세 할 것으로 판단.

서울 외환시장

(단위 : 원)

구분	달러/원	위안/원
시가	1,102.50	170.19
고가	1,106.70	170.24
저가	1,100.50	169.73
종가	1,106.50	169.73
전일비	+5.80	-0.60
평균환율	1,103.00	170.07
NDF(1M)	1,102.12	
거래량	98(억불)	102(억위안)

주요 통화 환율

통화	환율	전일비
USD/KRW	1,106.50	+5.80
JPY/KRW	1,066.71	+5.39
EUR/KRW	1,342.30	+1.53
GBP/KRW	1,510.70	+1.09
AUD/KRW	850.79	-1.54
XAU/KRW	66,032.71	+504.72
USD/JPY	103.60	-0.13
EUR/USD	1.2160	+0.0023

금리 장외파생상품 (원화)

(단위 : %)

만기	IRS	전일비	CRS	전일비
1Y	0.785	+0.00	0.135	-0.03
2Y	0.9025	-0.00	0.16	-0.03
3Y	1.01	-0.00	0.195	-0.03
4Y	1.1025	-0.00	0.235	-0.03
5Y	1.1775	-0.01	0.31	-0.02
7Y	1.26	-0.00	0.465	-0.02
10Y	1.3525	-0.00	0.655	-0.02

기준 금리 및 채권금리 (원화)

구분	종가	전일비
CD 91일물	0.69	+0.00
통안 1년	0.693	+0.01
통안 2년	0.907	+0.00
국고채 3년	1.007	+0.00
국고채 5년	1.348	-0.00
국고채 10년	1.77	-0.01
국고채 선물(3년)	111.47	+0.03

단기 FX Swap Point (원화)

(단위 : 전)

만기	종가(Mid)	전일비	CRS 환산
1M	10	+5	0.24%
3M	-10	-5	0.18%
6M	-40	-20	0.16%
1Y	-80	-10	0.15%

금리 장외파생상품 (미국)

(단위 : %)

만기	국채	전일비	IRS	전일비
1Y	0.088	-0.00	0.189	-0.00
2Y	0.122	-0.00	0.208	+0.01
3Y	0.177	+0.00	0.260	+0.00
5Y	0.408	+0.00	0.490	-0.01
10Y	1.032	-0.00	1.062	+0.01

주요 증시

증시	종가	전일비	
KOSPI	3,140.31	-68.68	-2.14%
미국 DOW	30,937.04	-22.96	-0.07%
중국 상해종합	3,569.43	-54.81	-1.51%
일본 NIKKEI225	28,546.18	-276.11	-0.96%
영국 FTSE100	6,654.01	+15.16	+0.23%

기타

종목	종가	전일비
WTI 선물($)	52.61	-0.16
금 선물($)	1,849.50	-5.95
3M $ LIBOR(%)	0.21288	-0.00237
3M ¥ LIBOR(%)	-0.07300	-0.00167
KOR 5Y CDS	25.43	+0.04

· 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.