DGB 일일 외환시장 동향 및 전망

DGB Daegu Bank

1. 전일 주요시장지표

14.JUN.2021

	LOW	HIGH	CLOSE	최초고시	INDEX	CLOSE	CHANGE	INDEX	CLOSE	CHANGE
USD/KRW	1114.0	1117.0	1115.8	1115.00	3M CD	0.66	+0.000	DOW	34466.24	+19.10
USD/JPY	109.27	109.80	109.33	1019.62	3Y 국고채	1.274	+0.139	Nasdaq	14020.33	+108.58
EUR/USD	1.2142	1.2194	1.2176	1357.46	3M LIBOR	0.119	-0.006	Gold($)	1898.25	+9.59
USD/CNY	6.3774	6.3945	6.3860	174.65	10Y 미국채	1.4437	-0.046	WTI($)	70.29	+0.33

2. FX Market

금 일 예 상 거 래 범 위			3일최저	3일최고
USD/KRW	1,113.0	1,119.0	1110.9	1118.5
JPY/KRW	1,015.0	1,020.0	1015.6	1021.7
EUR/KRW	1,349.0	1,353.0	1353.2	1362.8

금 일 예 상 거 래 범 위			3일최저	3일최고
USD/JPY	108.94	109.99	109.56	109.80
EUR/USD	1.2118	1.2223	1.2142	1.2218
USD/CNY	6.3689	6.4031	6.3774	6.4017

USD / KRW SPOT

USD INDEX SPOT

전 일 서 울 외 환 시 장 종 합

전일 서울 외환시장에서 달러-원 환율은 달러 인덱스 약세에 연동하며 전 거래일 대비 5.00원 하락한 1,110.80원에서 거래를 마감함.

전전일 뉴욕증시는 美 소비자물가지표가 테이퍼링을 유발할 정도는 아니라는 안도감에 나스닥 지수가 0.78% 상승하여 달러원 환율은 1,113.00원에서 하락 출발 하였음. 개장 직후 네고 물량이 대거 유입되며 1,113.00원이 시가이자 고가였고 이후 빠르게 1,109.80원까지 저점을 낮췄으나 저점 매수 대기 물량 및 실수요성 결제 물량에 하단 지지되었음. 이후 코스피는 반등하며 3,250을 돌파하였고 달러원 환율은 결제와 네고 공방 속에 1,110.00원 전후로 등락을 무겁게 이어나간 뒤 1,110.80원에서 종가를 형성함. 1,109.80~ 1,113.00

역외 차액결제선물환(NDF) 시장에서 달러원 1개월물은 달러 인덱스 강세 속 1,116.50원에 최종 호가됨. 최근 1개월물 스와프포인트(-0.10원)을 고려하면 전 거래일 서울외환시장 종가 대비 5.80원 상승함.

국 제 금 융 시 장 종 합

전일 미국 미시간대발표 소비자심리가 시장 예상치를 상회하고 5월 소비자물가가 기저를 감안하여도 5%로 08년래 최대치로 나왔음에도 불구하고 미채권 수익률은 강세를 보였으며 미증시도 상승세를 이어감. ECB에 이어 연준또한 완화적 통화정책을 이어갈 것이라는 시장의 신뢰가 형성된 것으로 풀이됨.

미국채 10년 수익률은 장중 1.43%까지 하락 후 1.45%로 마감함. 인플레이션과 관련된 연준의 반복된 레토릭이 일부 숏커버링으로 이어지며 강세를 보임. 국제유가는 수요회복 전망에 상승세를 지속하며 배럴당 70.91달러를 기록함.

글로벌 달러화는 FOMC를 앞두고 강세를 보임. 상당기간 완화적 통화정책 기조를 이어갈것으로 보이는 유로존보다 상대적으로 미국이 먼저 통화정책 경로를 바꿀 수 있다는 심리가 시장에 퍼지며 달러화는 유로화 및 파운드화 대비 강세를 보였음.

달러/원 금일 예상

◎ 금일 서울외환시장은 역외 차액결제선물환(NDF) 환율을 반영해 1,116.00원선에서 개장할 것으로 보임.
◎ 뉴욕증시는 전날 발표된 물가 지표를 안정적으로 소화하면서 사상 최고치로 마감을 하였고 또한 유럽중앙은행(ECB)의 완화적인 스탠스 유지에 유로화가 약세를 보여 달러화가 강세로 반등하였음. 금일 달러원 환율은 이를 반영하여 소폭 상승 압력 받을것으로 예상됨. 숏 커버 및 실수요성 결제 물량은 상승 요인이나 고점 매도 대기 중인 수출업체 네고 물량에 상단은 제한 될 것으로 보여 1,110원 중후반대에서 제한적 상승 시도가 예상됨. 국내 증시 외인 매매 동향 및 주요 아시아 증시에 주목해야 할 것으로 보임.

3. Derivatives

USD/KRW 선물환 스왑포인트 (단위:원)

만기	1개월	3개월	6개월	12개월
매입율	-1.10	-2.70	-4.10	-7.80
매도율	0.90	2.30	3.90	8.20

IRS(원화이자율스왑) CRS(USD/KRW통화스왑)

만기	1년	2년	3년	5년
IRS	0.9000	1.1700	1.3575	1.5275
CRS	0.2100	0.3150	0.4250	0.8000

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