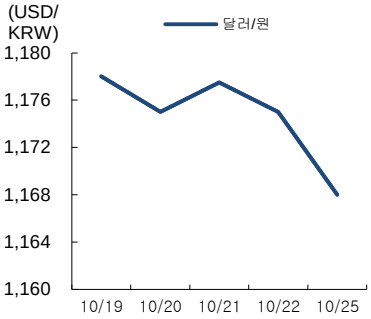
Daily

외환/금리스왑 동향 및 전망

2021-10-26

외환시장



딜러 전망치	예상레인지	
	저점	고점
원달러	1165	1173
엔달러	113.2	114.6
원엔	1020	1035
달러유로	1.154	1.168
원유로	1350	1370

전일 동향

Seoul 달러원은 1178.0원에 개장 후 주식시장 상승 및 중공업체 대형 수주 공시 뉴스, 주요 통화들의 달러 약세 움직임이 겹쳐지면서 오전 장 중 대폭 하락하였고 오후 장에도 네고 이어지면서 반등 없이 전일 대비 8.7원 하락한 1168.4원에 마감하였음. 외국인들이 주식, 채권에서 별다른 거래 없는 가운데서도 양방 수급이 반영되어 거래량은 100억불을 상회 하였음. 뉴욕 NDF 는 1169.05원 (스팟 1168.15원)에 마감하였음.

금일 전망

원/달러 뉴욕장 에서 미국 주식 시장이 강세를 보이고 주요 통화는 달러 강세 움직임을 보였으나 달러원은 선반영된 듯 미미한 움직임을 보였음. 최근의 하락 움직임에 이어 어제 10원 가까운 하락세를 보인 만큼 주식 및 주요 통화들의 움직임에 연동하되 일정 부분 반등 시도가 있을 것으로 예상됨.

예상범위 : 1,165~1,173원

엔/달러 간밤 미국 증시와 더불어 채권 가격도 강세를 보여 미국채 10년물 수익률은 1.63%대로 하락하였고, 일본 자국 내 정치적 이슈로 자민당이 패배하며 총선 관련 불확실성이 커지자 달러엔은 강보합세를 보임. 금일은 미국 발 위험자산 선호 심리로 글로벌 달러가치가 상승함에 따라 엔화는 약보합 흐름 보일 것으로 예상됨.

엔/달러 예상범위 : 113.2~114.6엔 | 원/엔(100) 예상범위 : 1,020~1,035원

달러/유로 테슬라가 12% 이상 상승하고, 기술주들이 전반적으로 강세를 띠자 다우지수는 연일 사상최고치를 경신하며 위험자산 선호 분위기가 이어지는 모습. 유럽증시는 ECB를 앞두고 혼조세를 보이며 상대적으로 부진한 모습 보여 금일 유로화는 무거운 흐름 보일 것으로 예상되나, 유로존 인플레이션 지표 발표 등에 따라 변동성 보일 가능성 있음.

달러/유로 예상범위 : 1.154~1.168달러 | 원/유로 예상범위 : 1,350~1,370원

스왑시장

금리 스왑(IRS) 동향 및 전망

전일 전일 IRS 금리는 미국금리 하락에 연동되어 하락하며 출발함. 추가 세수 국채 상환 소식에 금리는 하락압력을 이어갔고, 외국인도 국채선물 매수세를 보였음. 하지만, 오후 들어 미국금리가 상승하였고, 대기하고 있던 비드가 유입 되면서 금리는 전일 대비 상승하며 마감함.

금일 금일 IRS 금리는 상승흐름을 이어갈 것으로 전망함. 초과 세수 국채 상환 소식으로 장기금리가 소폭 하락하기도 하였으나, 시장의 매수 심리가 살아나기는 어려워 보임. 금일 발행 경계감까지 더해지면서 금리의 상승세는 지속될 것으로 예상함.

통화 스왑(CRS) 동향 및 전망

전일 전일 CRS 금리는 원화 금리 상승세에 연동되며 상승하는 모습을 보였음. 중장기 구간 중심으로 비드가 유입되면서 상승압력을 받았음. FX Swap이 보합권을 보이면서 단기구간은 상승세가 제한 되었고, 전일 대비 전 구간 상승하며 마감함.

금일 금일 CRS 금리는 소폭 상승압력이 우세할 것으로 전망함. 원화 금리의 상승압력이 지속되는 가운데 CRS 금리도 상승세가 이어질 것으로 보임. 다만, 레벨 고점 인식에 따른 오퍼가 유입될 가능성도 있어 상승폭은 제한적일 것으로 예상함.

서울 외환시장

(단위 : 원)

구분	달러/원	위안/원
시가	1,178.00	184.49
고가	1,178.50	184.56
저가	1,167.40	183.13
종가	1,168.40	183.21
전일비	-8.70	-0.99
평균환율	1,171.80	183.28
NDF(1M)	1,169.74	
거래량	112(억불)	126(억위안)

주요 통화 환율

통화	환율	전일비
USD/KRW	1,168.40	-8.70
JPY/KRW	1,028.52	-3.93
EUR/KRW	1,362.00	-6.61
GBP/KRW	1,610.11	-13.93
AUD/KRW	874.90	-4.93
XAU/KRW	67,512.25	-216.43
USD/JPY	113.70	+0.24
EUR/USD	1.1606	-0.0041

금리 장외파생상품 (원화)

(단위 : %)

만기	IRS	전일비	CRS	전일비
1Y	1.5800	+0.01	0.9400	+0.01
2Y	1.8775	+0.03	1.0150	+0.01
3Y	1.9875	+0.03	1.1350	+0.01
4Y	2.0500	+0.03	1.2850	+0.02
5Y	2.0800	+0.04	1.4150	+0.03
7Y	2.1050	+0.04	1.5550	+0.02
10Y	2.1350	+0.04	1.6950	+0.03

기준 금리 및 채권금리 (원화)

구분	종가	전일비
CD 91일물	1.09	+0.00
통안 1년	1.195	+0.02
통안 2년	1.682	+0.02
국고채 3년	1.919	+0.03
국고채 5년	2.240	+0.04
국고채 10년	2.426	+0.02
국고채선물(3년)	108.42	-0.06

단기 FX Swap Point (원화)

(단위 : 전)

만기	SWAP Point	Change	Implied CRS
1M	90	+5	0.94%
3M	185	+0	0.75%
6M	400	+0	0.86%
1Y	730	+0	0.92%

금리 장외파생상품 (미국)

(단위 : %)

만기	국채	전일비	IRS	전일비
1Y	0.117	+0.00	0.268	-0.01
2Y	0.434	-0.02	0.615	-0.01
3Y	0.746	-0.03	0.908	-0.01
5Y	1.170	-0.03	1.261	+0.00
10Y	1.632	-0.01	1.647	+0.02

주요 증시

증시	종가	전일비	
KOSPI	3,020.54	+14.38	+0.48%
미국 DOW	35,741.15	+64.13	+0.18%
중국 상해종합	3,609.86	+27.26	+0.76%
일본 NIKKEI 225	28,600.41	-204.44	-0.71%
영국 FTSE 100	7,222.82	+18.27	+0.25%

기타

종목	종가	전일비
WTI (선물)	83.58	-0.62
금 (선물)	1,808.65	+14.70
3M $ LIBOR	0.12488	+0.00125
3M ¥ LIBOR	-0.08267	+0.00200
KOR 5Y CDS	19.76	-0.10

· 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.