DGB 일일 외환시장 동향 및 전망

DGB Daegu Bank

1. 전일 주요시장지표

26.OCT.2021

	LOW	HIGH	CLOSE	최초고시	INDEX	CLOSE	CHANGE	INDEX	CLOSE	CHANGE
USD/KRW	1167.4	1178.5	1168.4	1171.80	3M CD	1.09	+0.000	DOW	35741.15	+64.13
USD/JPY	113.42	113.92	113.72	1030.38	3Y 국고채	1.930	+0.030	Nasdaq	15226.71	+136.51
EUR/USD	1.1589	1.1665	1.1609	1360.17	3M LIBOR	0.135	+0.010	Gold($)	1807.80	+15.19
USD/CNY	6.3740	6.3882	6.3826	183.28	10Y 미국채	1.6353	-0.001	WTI($)	83.76	+0.00

2. FX Market

금 일 예 상 거 래 범 위			3일최저	3일최고
USD/KRW	1165.0	1171.0	1167.4	1180.5
JPY/KRW	1024.0	1029.0	1025.2	1037.9
EUR/KRW	1352.0	1358.0	1353.9	1373.4

금 일 예 상 거 래 범 위			3일최저	3일최고
USD/JPY	113.18	114.19	113.92	114.41
EUR/USD	1.1545	1.1697	1.1589	1.1667
USD/CNY	6.3674	6.3958	6.3740	6.3999

USD / KRW SPOT

USD INDEX SPOT

전 일 서 울 외 환 시 장 종 합

전일 서울외환시장에서 달러-원 환율은 위험 자산 선호 심리 회복과 중공업 수주 소식에 전 거래일 대비 8.70원 하락한 1,168.40원에 거래를 마감함.

글로벌 달러화 강세에 1,178.00원선에서 상승 출발하였으나 장 초반 코스피가 3,000선을 회복하는 등 위험 선호 심리 우위와 국내 중공업체의 연이은 수주 소식에 네고 물량 유입되며 1,170원을 하향 돌파하였음. 장 후반에는 저가 매수 및 결제 유입에 1,160원 후반대에서 등락을 거듭한 뒤 1,168.40원 에서 종가를 형성함. 거래 범위 : 1,167.40 ~ 1,178.50

역외 차액결제선물환(NDF) 시장에서 달러-원 1개월물은 다른 주요 통화들과 함께 제한된 등락이 이어져 1,169.05원에 최종 호가됨. 최근 1개월물 스와프 포인트(0.90원)을 고려하면 전 거래일 서울외환시장 종가 대비 0.25원 하락함.

국 제 금 융 시 장 종 합

전일 미증시는 주요 기술주들의 실적 발표를 앞둔 가운데 테슬라의 시가총액이 1조달러를 넘으면서 주요지수 상승을 이끌었음. 기업들의 3분기 실적도 84% 이상이 예상치를 웃돌면서 고점 우려에도 불구 지수 상승이 이어지고 있음.

미국채 수익률은 하락하였음. 10년물은 1.635%, 30년물은 2.085%. 내년 금리 인상에 대한 시장의 시각은 유지되고 있으나 기술적 움직임이 일부 있었으며 재닛 옐런 재무장관은 언론과의 인터뷰에서 내년 하반기께 연준목표치인 2% 대로 회귀할것으로 전망하며 기존 시각을 견지함.

글로벌 달러화는 최근 한달래 최저치 부근에서 반등하며 유로에 대해서는 강세 엔화 | 에 대해서는 약세를 보임. 유로 대 달러화 환율은 1.16초반까지 반빅가랄 밀렸으며 엔화도 113엔대 후반에서 거래됨.

달 러 / 원 금 일 예 상

◎ 금일 서울외환시장은 역외 차액결제선물환(NDF) 환율을 반영해 1,168원선에서 개장할 것으로 보임.
◎ 전일 뉴욕증시는 기술기업들의 실적 발표를 주시하는 가운데 렌터카 업체 허츠가 테슬라를 10만대 주문 했다는 소식에 테슬라 주가가 1천달러를 넘어서는 등 위험 자산 선호 심리 우위에 3대지수 모두 상승하였음. 금일 달러원 환율은 글로벌 리스크 온 지속과 국내 중공업 수주 소식 여파로 1,160원대에서 하락 압력 받을 것으로 예상되나 테이퍼링 우려 및 달러원 환율이 1달여만에 1,160원대에 진입한만큼 하단은 일부 지지될 것으로 보임.

3. Derivatives

USD/KRW 선물환 스왑포인트 (단위:원)

만기	1개월	3개월	6개월	12개월
매입율	-0.10	-0.65	-0.20	-0.70
매도율	1.90	4.35	8.20	15.30

IRS(원화이자율스왑) CRS(USD/KRW통화스왑)

만기	1년	2년	3년	5년
IRS	1.5800	1.8775	1.9875	2.0800
CRS	0.9400	1.0150	1.1350	1.4150

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