



2021.10.26 (화)

### 달러/원 환율 1 개월 추이



- 일일 외환 거래량 U\$ 112.45 억
- 외인 주식 순매도 108 억원

약달러 기조와 역외 기관 중심의 매도 물량 대거 출현으로 하락 마감

미국 다우지수와 S&P 지수는 사상 최고 증가를 기록

금일 달러-원 환율은 1,160 원대 초중반에서 하단은 제한될 전망

### □ Market Rates (2021.10.25)

| 환율        | 시가      | 고가      | 저가      | 증가             | 전일 대비   |
|-----------|---------|---------|---------|----------------|---------|
| 달러/원(서울)  | 1,178.0 | 1,178.5 | 1,167.4 | <b>1,168.4</b> | △8.7    |
| 달러/원(NDF) | 1,169.2 | 1,171.4 | 1,167.5 | <b>1,169.1</b> | △9.9    |
| 달러/엔      | 113.60  | 113.93  | 113.44  | <b>113.72</b>  | +0.24   |
| 유로/달러     | 1.1644  | 1.1666  | 1.1590  | <b>1.1608</b>  | △0.0041 |

| 스왑 포인트 | BID | OFFER | MID        | 전일 대비 |
|--------|-----|-------|------------|-------|
| 1 개월   | 40  | 140   | <b>90</b>  | +5    |
| 3 개월   | 60  | 310   | <b>185</b> | -     |
| 6 개월   | 200 | 600   | <b>400</b> | +10   |
| 12 개월  | 480 | 980   | <b>730</b> | -     |

| 금리 | IRS         |       | CRS         |       | Swap Basis | 국고채         | USD  |      |
|----|-------------|-------|-------------|-------|------------|-------------|------|------|
|    | 증가          | 전일비   | 증가          | 전일비   |            |             | IRS  | 미국채  |
| 1년 | <b>1.58</b> | +0.01 | <b>0.94</b> | +0.01 | △64        | <b>1.17</b> | 0.27 | 0.12 |
| 3년 | <b>1.99</b> | +0.03 | <b>1.14</b> | +0.01 | △85        | <b>1.89</b> | 0.90 | 0.75 |
| 5년 | <b>2.08</b> | +0.04 | <b>1.42</b> | +0.03 | △66        | <b>2.20</b> | 1.25 | 1.17 |

### □ 전일 서울 종합

전일 달러-원 환율은 달러지수가 1개월 만에 가장 낮은 수준으로 하락하는 약달러 분위기가 계속되며, 장 초반부터 역외 기관을 중심으로 매도 물량이 대거 출회하여 환율 하락을 주도했으며, 점심시간 전후 코스피가 상승 전환하며 환율의 하방 압력을 더한 가운데 전일 대비 8.7원 하락한 1,168.4원에 장을 마감

### □ 뉴욕/런던 종합

전일 미국 증시는 대형 기술 기업들의 3분기 실적 발표가 본격화된 가운데 다우지수와 S&P500지수가 사상 최고 증가를 기록. 나스닥 지수도 지난 9월 7일 기록한 사상 최고 증가에 근접. 달러지수는 1개월만의 최저치에서 반등

### □ 금일 전망 (2021.10.26)

**[예상 환율 : 1,164 원~ 1,170 원]**

금일 달러-원 환율은 월말 네고물량 대기 속에 리스크온 분위기가 이어질 경우, 전일에 이어 환율은 하방 압력을 받겠지만, 뉴욕장에서 미 금리가 성장둔화 우려 속에 하락한 만큼 1,160 원대 초중반에서 하단은 제한될 것으로 전망

금일 원화 IRS 는 예상보다 부진한 3 분기 GDP 지표와 전일 미 금리 하락에 영향을 받을 것으로 보이나, 20 년물 입찰결과가 주목 예상되고, CRS 금리는 IRS 와의 베이스, 1 년 스왑포인트에 연동되며 방향성 결정될 것으로 보임

주요 경제지표 및 이벤트  
(한국시간 기준)

[미 국] 8월 주택가격(22:00), 9월 신규주택 판매(23:00)  
 [일 본] BOJ 통화정책회의 (28일 까지)