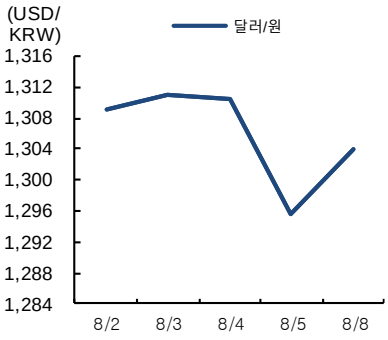
Daily

외환/금리스왑 동향 및 전망

2022-08-09

외환시장



딜러 전망치	예상레인지	
	저점	고점
달러원	1298	1308
달러엔	134.5	135.8
엔원	955	972
유로달러	1.017	1.027
유로원	1320	1343

전일 동향

Seoul 전일 종가 대비 6.7원 상승한 1,305.0원에 개장한 달러원 환율은 호조를 보인 미 고용지표 여파로 연준의 공격적인 긴축 전망이 강화되며 상승 흐름을 보임. 또한 미-중 갈등도 달러원에 상승압력을 더함. 그러나 외국인 투자자들이 8거래일 연속 순매수를 보이자 변동폭이 제한된 가운데 전일 종가 대비 8.1원 상승한 1,306.4원에 거래를 마감.

금일 전망

달러/원 간밤 달러원 환율은 달러화가 약세를 보인 영향으로 전일 종가대비 5.3원 하락한 1,301.1에서 NDF거래를 마감함. 금일 달러원 환율은 코스피 움직임에 주목하며 가운데 미 CPI 관망세 속에 1,300원을 중심으로 움직일 것으로 예상됨. 그러나 연준 인사들의 매파적인 발언이 이어지고 있어 하단 제한될 것으로 보임

예상범위 : 1,298원 ~1,308원

달러/엔 전일 미 고용지표의 호조로 상승했던 미 10년 국채수익률로 인하여 달러대비 약세 흐름 보였던 엔화는 고용지표 호조의 파장이 소화되며 다시 134 수준으로 복귀함. 달러 강세 흐름 다소 누그러졌으나 계속되는 연준 의원들의 매파적인 발언으로 엔화 강세 제한될 것으로 보이며 미 CPI 발표 기다리며 보합 흐름 예상됨

달러/엔 예상범위 : 134.5엔~135.8엔 | 엔/원(100) 예상범위 : 955~972원

유로/달러 고용지표 호조의 파장이 주말을 지나면서 가라앉자 상대적으로 약세였던 유로화가 상승하며 강세 보임. 금일 유로화는 미국 증시 호조 등 다시금 살아난 위험선호 심리 등으로 달러 강세 제한되며 추가 상승 모멘텀 있겠으나 여전히 상존하는 연준의 강도 높은 긴축 의지에 상승세 막히고 미 CPI 발표 대기하며 큰 폭의 움직임은 제한될 것으로 보임

유로/달러 예상범위 : 1.017~1.027달러 | 유로/원 예상범위 : 1320~1343원

스왑시장

금리 스왑(IRS) 동향 및 전망

전일 전일 IRS 금리는 미국 고용지표 호조에 따른 미국 금리 상승을 반영 하여 상승하는 모습을 보였음. 또한, 높은 임금 상승률에 따른 인플레 우려로 연준의 긴축 지속 가능성이 높아졌음. 전일 대비 전 구간 상승하며 마감함.

금일 금일 IRS 금리는 글로벌 금리 흐름 및 외국인의 선물 매매 방향에 연동되며 등락을 보일 것으로 전망됨. 다만, 미국금리 상승에 비해 국내금리 상승세가 제한되는 등 저가 매수세 유입가능성도 높아지고 있어 금리의 추가 상승세는 제한적일 것으로 판단됨.

통화 스왑(CRS) 동향 및 전망

전일 전일 CRS 금리는 미국 금리 및 원화 금리 상승에 영향을 받으며 상승하는 모습을 보였음. 또한, 해외채 발행 부채스왑의 헷지성 비드 수요도 지속 되면서, 전일 대비 전 구간 상승하며 마감함.

금일 금일 CRS 금리는 전반적인 원화 금리 흐름에 연동되며 등락을 보일 것으로 전망됨. 다만, 최근 누적된 부채스왑으로 상승폭이 컸고, 추가적인 베이시스 스왑 축소는 제한적일 것으로 판단되어, 하락압력이 소폭 우세할 것으로 보임.

서울 외환시장

(단위 : 원)

구분	달러/원	위안/원
시가	1,305.00	192.80
고가	1,306.70	193.02
저가	1,302.50	192.58
종가	1,306.40	193.01
전일비	+8.10	+0.74
평균환율	1,304.80	192.73
NDF(1M)	1,299.44	
거래량	55(억불)	59(억위안)

주요 통화 환율

통화	환율	전일비
USD/KRW	1,306.40	+8.10
JPY/KRW	966.16	-7.91
EUR/KRW	1,330.83	+2.54
GBP/KRW	1,577.61	+0.95
AUD/KRW	906.18	+1.53
XAU/KRW	74,538.61	-156.35
USD/JPY	135.00	+0.03
EUR/USD	1.0195	+0.0014

금리 장외파생상품 (원화)

(단위 : %)

만기	IRS	전일비	CRS[1]	전일비
1Y	3.1600	+0.04	2.2650	+0.06
2Y	3.1750	+0.05	2.3100	+0.07
3Y	3.1050	+0.04	2.3350	+0.07
4Y	3.0625	+0.04	2.2400	+0.07
5Y	3.0225	+0.04	2.1700	+0.05
7Y	2.9650	+0.03	2.0200	+0.04
10Y	2.9100	+0.03	1.9750	+0.03

1) 3개월 주기로 무위험지표 복리평균금리(Compounded SOFR) 3개월물과 교환되는 원화 고정금리

기준 금리 및 채권금리 (원화)

구분	종가	전일비
CD 91일물	2.75	+0.01
통안 1년	2.886	-0.02
통안 2년	3.125	+0.05
국고채 3년	3.134	+0.05
국고채 5년	3.151	+0.05
국고채 10년	3.177	+0.05
국고채선물(3년)	105.27	-0.14

단기 FX Swap Point (원화)

(단위 : 전)

만기	SWAP Point	전일비	Implied CRS
1M	-60	+0	1.84%
3M	-240	-15	2.00%
6M	-670	-60	2.10%
1Y	-1,400	-110	2.29%

금리 장외파생상품 (미국)

(단위 : %)

만기	국채	전일비	IRS[2]	전일비
1Y	3.259	+0.01	3.351	-0.02
2Y	3.207	-0.02	3.175	-0.03
3Y	3.136	-0.03	2.932	-0.04
5Y	2.905	-0.05	2.656	-0.05
10Y	2.749	-0.08	2.530	-0.08

2) 1년 주기로 무위험지표 복리평균금리(Compounded SOFR) 1년물과 교환되는 달러 고정금리

주요 증시

증시	종가	전일비	
KOSPI	2,493.10	+2.30	+0.09%
미국 DOW	32,832.54	+29.07	+0.09%
중국 상해종합	3,236.93	+9.91	+0.31%
일본 NIKKEI 225	28,249.24	+73.37	+0.26%
영국 FTSE 100	7,482.37	+42.63	+0.57%

기타

종목	종가	전일비
WTI (선물)	90.48	+2.45
금 (선물)	1,805.40	+15.10
3M $ LIBOR	2.86671	0.00000
3M EURIBOR	0.27700	0.00000
KOR 5Y CDS	40.04	-2.60

· 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.