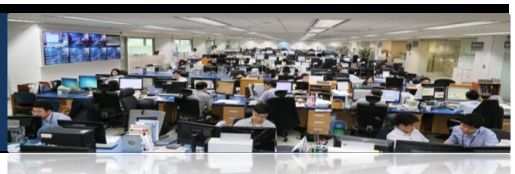
KDB Market Daily

2022.08.09. (화)

KDB산업은행
금융공학실
02-787-7315
kdbfx2@kdb.co.kr



달러/원 환율 1 개월 추이

☞ 전일 거래 동향

· 일일 외환 거래량 $55.41 억

· 외인 주식 순매수 1,161 억원

□ Market Rates (2022.08.08)

환 율	시 가	고 가	저 가	종 가	전일 대비
달러/원(서울)	1,305.0	1,306.7	1,302.5	1,306.4	8.1
달러/원(NDF)	1,305.7	1,306.3	1,298.7	1,300.5	△3.5
달러/엔	135.02	135.59	134.36	135.20	0.03
유로/달러	1.0179	1.0223	1.0159	1.0197	0.0014

스왑 포인트	BID	OFFER	MID	전일 대비
1 개월	△110	△10	△60	△5
3 개월	△365	△115	△240	△20
6 개월	△860	△460	△660	△50
12 개월	△1630	△1130	△1380	△100

금 리	IRS		CRS		Swap Basis	국고채	USD	
	종가	전일비	종가	전일비			IRS(SOFR)	미국채
1 년	3.16	0.04	2.27	0.06	△89	2.91	3.35	3.26
3 년	3.11	0.05	2.34	0.07	△77	3.13	2.93	3.14
5 년	3.02	0.04	2.17	0.05	△85	3.14	2.65	2.91

□ 전일 서울 종합

1,300 원 초중반 횡보세

1305.0 원으로 상승 출발, 개장 후 추가적인 재료 부재한 가운데 한산한 수급 속 1300 원 초중반에서 횡보세를 보이다, 오후 들어 역외 매수와 국내 결제수요에 완만한 상승세를 보이며 전일대비 8.1 원 상승한 1306.4 원으로 마감

□ 뉴욕/런던 종합

전일 대비 달러지수 소폭 하락

전일 미 고용지표 호조에 달러가 강세를 보인 후 7 월 소비자물가지수(CPI) 발표를 대기하는 가운데 거래 후반 106.43 으로 전일 대비 달러지수 소폭 하락

주요 주가지수 혼조세로 마감

연준의 긴축 행보에 따른 경기침체 가능성이 주목받으며 주요 주가지수가 보합권에서 혼조세로 마감. 다우존스는 0.23% 상승하였으나, S&P500 은 0.12% 및 나스닥 0.1% 하락

□ 금일 전망 (2022.08.09) [예상 환율 : 1,298 ~ 1,303 원]

1300 원대 초반 등락 전망

간밤 달러화 가치 하락한 가운데 중국 경기 회복 기대감 속 위안화 강세와 최근 이어진 외인의 증시 순 매수세 영향으로 하락 압력을 받겠으나, 국내 결제수요에 하단 지지하며, 미 7 월 물가지표 발표를 대기 속 1300 원대 초반에서 주로 등락할 듯

전일 미 금리는 익일 발표되는 7 월 CPI 대기하며 전일 고용지표 호조에 급등했던 상승세를 되돌림하며 하락한 가운데 금일 원화 IRS 는 국고채 2 년물 입찰 소화와 경제지표 발표 경계하며 변동성 제한될 것으로 보이고, CRS 금리는 꾸준한 에셋스왑 물량과 장단기 플래트닝을 확인하며 오퍼 우위 예상됨

주요 경제지표 및 이벤트
(한국시간 기준)

[일 본] 경상수지 NSA(08:50)
[미 국] 7월 고용추이 (23:00)

본 자료는 작성자의 의견으로 참고자료로만 사용 가능하며, 은행의 공식 입장은 아님을 유념하시기 바랍니다.