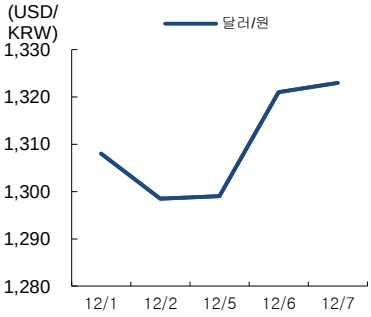
Daily

외환/금리스왑 동향 및 전망

2022-12-08

외환시장



딜러 전망치	예상레인지	
	저점	고점
달러원	1305	1325
달러엔	135.8	137.0
엔원	953	976
유로달러	1.045	1.060
유로원	1364	1404

전일 동향

Seoul 달러원은 1,322원에 개장 후 네고 위주 수급 반영되면서 1,320원 하향돌파하고 무거운 모습 보임. 중국이 코로나 방역 완화 조치 발표에 추가 하락하여 1,312.0원에 저점 보인 후 달러 강세 움직임에 전일 대비 2.9원 오른 1,321.7원에 마감. 외국인은 주요 통화들 따라 선물 거래 방향을 자주 뒤집는 모습 보였고 주식은 2천억원 가량 순매도.

금일 전망

달러/원 뉴욕 장에서 경기 침체 경계감 영향으로 미국채 금리가 대폭 하락하면서 달러원 NDF는 7원 가까이 하락한 1,314.3원 (스팟 1,314.75원)에 마감하였음. 금일 1,300원 중후반대는 결제 유입으로 지지 예상되나 미국채 금리 추가 하락에 따른 달러 약세 재개에 유의할 필요 있음.

예상범위 : 1,305~1,325원

달러/엔 전일 엔화는 미국 연준의 긴축 정책이 시장 예상보다 장기화 될 수 있다는 우려에 한 때 소폭 약세를 보였으나 이내 미국 10년물 국채수익률이 하락하면서 강세로 전환하는 모습. BOJ 위원들은 초완화적인 통화정책을 고수할 것이라고 지속적으로 밝히고 있음에도 엔화는 강세를 이어감. 금일 엔화는 미국 10년물 국채수익률 하락세에 따라 강세 흐름 이어갈 것으로 예상.

달러/엔 예상범위 : 135.8~137.0엔 | 엔/원(100) 예상범위 : 953~976원

유로/달러 전일 유로화는 미국 연준이 예상보다 장기간 할 수 있다는 우려에 아시아 장 중에는 약세를 보였으나 중국이 사실상 제로 코로나 정책을 포기하면서 강세로 전환하는 모습. 천연가스 가격 상한제 합의 등 최근 유로화 가치를 지지하는 뉴스들과 함께 글로벌 시장에서 전반적인 달러 약세 흐름으로 금일 유로화는 강세 흐름 이어갈 것으로 예상.

유로/달러 예상범위 : 1.045~1.060달러 | 유로/원 예상범위 : 1,364~1,404원

스왑시장

금리 스왑(IRS) 동향 및 전망

전일 전일 IRS 금리는 전일 하락에 대한 되돌림으로 상승 마감함. 레벨 부담감으로 상승 출발한 국내 채권 금리는 장기 구간 위주로 강세시도가 있었으나, 장 막판 차익 실현 물량 유입되며 금리 상승 폭 확대 마감함.

금일 금일 IRS 금리는 박스권 흐름을 이어 갈 것으로 전망. 국내 채권 시장은 단기채 구간으로 레벨 부담감으로 추가 강세 제한되는 한편, 장기 구간 위주로 매수세 유입되며 장,단기 수익률 스프레드는 축소 압력이 우위를 보일 것으로 전망.

통화 스왑(CRS) 동향 및 전망

전일 전일 CRS 금리는 부채 물량 우위로 큰 폭 금리 상승 마감함. 2~3년 구간으로 부채 물량이 강하게 유입되며 상승 출발한 CRS 금리는 Fx swap 레벨 상승과 국내 금리 영향으로 상승 폭 확대 마감함.

금일 금일 CRS 금리는 부채 물량 미 해소로 상승 압력이 우위를 보일 것으로 전망. 다만 최근 CRS 금리 상승으로 스왑 베이시스 역전 폭이 크게 좁혀지며 추가적인 베이시스 축소는 제한되며 커브 플래트닝 압력이 우세 할 것으로 판단.

서울 외환시장

(단위 : 원)

구분	달러/원	위안/원
시가	1,322.00	189.18
고가	1,325.80	189.61
저가	1,312.00	188.30
종가	1,321.70	189.34
전일비	+2.90	+0.28
평균환율	1,319.50	189.02
NDF(1M)	1,314.44	
거래량	79(억불)	79(억위안)

주요 통화 환율

통화	환율	전일비
USD/KRW	1,321.70	+2.90
JPY/KRW	961.97	-0.83
EUR/KRW	1,383.29	-0.66
GBP/KRW	1,603.09	-4.99
AUD/KRW	885.01	-3.00
XAU/KRW	75,285.88	+269.77
USD/JPY	136.60	-0.45
EUR/USD	1.0505	+0.0036

금리 장외파생상품 (원화)

(단위 : %)

만기	IRS	전일비	CRS[1]	전일비
1Y	3.9250	+0.02	3.0950	+0.04
2Y	3.7375	+0.06	3.0100	+0.06
3Y	3.5575	+0.06	2.9700	+0.09
4Y	3.4600	+0.05	2.8550	+0.07
5Y	3.3700	+0.04	2.7500	+0.06
7Y	3.2650	+0.03	2.6750	+0.05
10Y	3.1675	+0.02	2.6300	+0.05

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

기준 금리 및 채권금리 (원화)

구분	종가	전일비
CD 91일물	4.03	+0.00
통안 1년	3.661	+0.02
통안 2년	3.792	+0.06
국고채 3년	3.672	+0.04
국고채 5년	3.620	+0.02
국고채 10년	3.523	+0.02
국고채선물(3년)	103.72	-0.14

단기 FX Swap Point (원화)

(단위 : 전)

만기	SWAP Point	전일비	Implied CRS
1M	-35	+10	3.92%
3M	-320	+20	3.47%
6M	-980	+20	3.25%
1Y	-2,280	+20	3.06%

금리 장외파생상품 (미국)

(단위 : %)

만기	국채	전일비	IRS[2]	전일비
1Y	4.670	-0.06	4.834	-0.04
2Y	4.262	-0.10	4.300	-0.10
3Y	3.993	-0.11	3.823	-0.13
5Y	3.627	-0.12	3.384	-0.13
10Y	3.420	-0.11	3.109	-0.10

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

주요 증시

증시	종가	전일비	
KOSPI	2,382.81	-10.35	-0.43%
미국 DOW	33,597.92	+1.58	+0.00%
중국 상해종합	3,199.62	-12.91	-0.40%
일본 NIKKEI 225	27,686.40	-199.47	-0.72%
영국 FTSE 100	7,489.19	-32.20	-0.43%

기타

종목	종가	전일비
WTI (선물)	72.53	-2.04
금 (선물)	1,798.90	+15.65
3M $ LIBOR	4.73457	+0.01114
3M EURIBOR	1.99300	+0.01800
KOR 5Y CDS	50.86	+1.38

· 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.