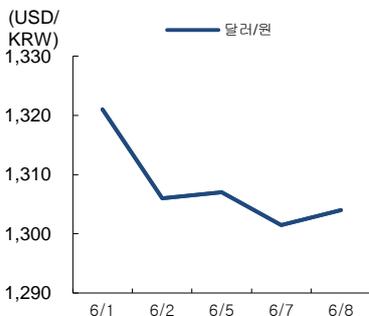


Daily

외환/금리스왑 동향 및 전망

2023-06-09

외환시장



달러 전망치	예상레인지	
	저점	고점
원달러	1292	1303
엔달러	138.2	139.5
원엔	926	943
달러유로	1.073	1.083
원유로	1386	1412

전일 동향

Seoul 미 연준의 금리 인상 경계감에 전일 대비 3.8원 상승한 1,307.6원에 개장한 달러원 환율은 장 초반 상승 흐름을 이어갔으나, 수출업체 네고 물량 출회에 상단이 제한되며, 상승폭을 반납해갔음. 오후 장 들어 개장이 부근에서 횡보하던 달러원 환율은 위안화 강세와 달러인덱스 하락에 반락하며 전일 증가 대비 0.1원 내린 1,303.7원에 마감함.

금일 전망

달러/원 역외 NDF 시장에서 달러원 환율은 미 연준의 기준금리 동결 전망이 힘을 얻음에 따라 하락세를 보여 현물환 기준 1,296.75원에 마감함. 금일 서울외환시장에서 달러원 환율은 미 FOMC 정례회의에서의 금리 인상 경계감 약화 영향이 이어지며 무거운 흐름을 보일 것으로 예상됨. 다만, 1,300원 아래에서의 결제 수요 유입 역시 활발할 것으로 보임에 따라 결제 수요 유입 정도가 환율 하락 폭과 속도를 제한할 것으로 전망됨.

예상범위 : 1,292~1,303원

달러/엔

간밤 미국 증시에서 아마존과 테슬라 등이 크게 상승하면서 위험선호 분위기를 이끌자 전일 캐나다 중앙은행 금리인상 이슈가 희석되었고, 미국 주간 실업수당 청구건수가 2년 만에 최고치를 기록해 미국채 수익률이 하락하였고 이에 연동해 달러엔 환율도 하락세를 보임. 금일 엔화는 달러가치 하락세로 강세 우위 보일 것으로 전망되나 오전 중국 물가지표에 변동성 보일 가능성 있음.

달러/엔 예상범위 : 138.2~139.5엔 | 엔/원(100) 예상범위 : 926~943원

유로/달러

전일 유로존 GDP가 전망치를 하회하였음에도 불구하고 유로화는 글로벌 달러약세에 연동하여 가치 상승하는 모습 보임. 간밤 미국 주간 실업수당 청구건수가 크게 늘자 6월 금리인상 기대감이 하락하여 미국채 수익률과 달러가치 동반 하락하는 모습 보이고 있어 금일 유로화는 강보합세 전망되나 미국 소비자 심리지수에 따라 다시 변동성 보일 가능성 있음.

유로/달러 예상범위 : 1.073~1.083 달러 | 유로/원 예상범위 : 1,386~1,412원

스왑시장

금리 스왑(IRS) 동향 및 전망

전일 전일 IRS 금리는 캐나다 중앙은행의 금리 인상과 외국인 투자자의 10년 국채 선물 대량 매도 여파로 큰 폭 상승 마감함. 미 금리 영향으로 약세 출발한 국내 채권 금리는 장중 외국인 투자자의 10년 국채 선물 대량 매도와 미 금리 추가 상승으로 금리 상승 폭 확대 마감함.

금일 금일 IRS 금리는 전일 급등에 대한 일부 되돌림 나오며 하방 압력이 우위를 보일 것으로 전망. 다만 채권 투자 심리 부진과 외국인 투자자의 추가 국채 선물 매도 경계감 작용하며 추가 상승은 제한되며 장,단기 수익률 스프레드는 축소 압력이 우세 할 것으로 판단.

통화 스왑(CRS) 동향 및 전망

전일 전일 CRS 금리는 대,내외 금리 영향으로 상승 마감함. 미 금리 영향으로 상승 출발한 CRS 금리는 에셋 스왑 물량 우위로 금리 하락 하기도 하였으나, 대,내외 금리가 상승 폭을 더하며 상승 전환하며 마감함.

금일 금일 CRS 금리는 에셋 스왑 우위 흐름 지속되며 하방 압력이 우위를 보일 것으로 전망. 2~3년 구간으로 에셋 스왑 물량이 해소되지 못하고 있어 금리 하방 압력이 우세 할 것으로 판단되며 장,단기 수익률 스프레드는 확대 될 것으로 전망.

서울 외환시장

(단위 : 원)

구분	달러/원	위안/원
시가	1,307.60	182.82
고가	1,308.40	183.07
저가	1,302.80	182.35
종가	1,303.70	182.54
전일비	-0.10	-0.19
평균환율	1,306.10	182.72
NDF(1M)	1,294.19	
거래량	103(억불)	250(억위안)

주요 통화 환율

통화	환율	전일비
USD/KRW	1,303.70	-0.10
JPY/KRW	932.38	-4.43
EUR/KRW	1,396.26	+3.28
GBP/KRW	1,622.59	+3.33
AUD/KRW	868.52	-2.09
XAU/KRW	81,451.13	-701.30
USD/JPY	138.91	-1.20
EUR/USD	1.0781	+0.0084

금리 장외파생상품 (원화)

(단위 : %)

만기	IRS	전일비	CRS ¹⁾	전일비
1Y	3.7600	+0.04	2.8350	+0.05
2Y	3.5750	+0.06	2.7150	+0.03
3Y	3.4600	+0.08	2.7050	+0.04
4Y	3.4000	+0.07	2.7150	+0.03
5Y	3.3600	+0.08	2.7400	+0.04
7Y	3.3350	+0.08	2.7250	+0.04
10Y	3.3350	+0.09	2.6950	+0.04

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

기준 금리 및 채권금리 (원화)

구분	종가	전일비
CD 91일물	3.75	+0.00
통안 1년	3.516	-0.02
통안 2년	3.609	+0.06
국고채 3년	3.543	+0.07
국고채 5년	3.533	+0.08
국고채 10년	3.632	+0.11
국고채선물(3년)	104.10	-0.23

단기 FX Swap Point (원화)

(단위 : 전)

만기	SWAP Point	전일비	Implied CRS
1M	-210	+0	3.16%
3M	-710	+15	3.05%
6M	-1,500	-10	3.01%
1Y	-2,960	-30	2.85%

금리 장외파생상품 (미국)

(단위 : %)

만기	국채	전일비	IRS ²⁾	전일비
1Y	5.133	-0.03	5.107	-0.02
2Y	4.516	-0.03	4.420	-0.03
3Y	4.169	-0.05	3.999	-0.05
5Y	3.857	-0.08	3.634	-0.07
10Y	3.717	-0.07	3.454	-0.07

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

주요 증시

증시	종가	전일비	
KOSPI	2,610.85	-4.75	-0.18%
미국 DOW	33,833.61	+168.59	+0.50%
중국 상해종합	3,213.59	+15.83	+0.49%
일본 NIKKEI 225	31,641.27	-272.47	-0.85%
영국 FTSE 100	7,599.74	-24.60	-0.32%

기타

종목	종가	전일비
WTI (선물)	70.98	-1.48
금 (선물)	1,980.60	+23.25
3M \$ LIBOR	5.50986	-0.00343
3M EURIBOR	3.45900	-0.01700
KOR 5Y CDS	37.66	-0.07

· 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.