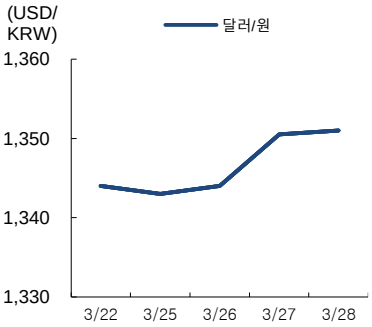
Daily

외환/금리스왑 동향 및 전망

2024-03-29

외환시장



딜러 전망치	예상레인지	
	저점	고점
달러원	1344	1356
달러엔	150.9	151.9
엔원	885	899
유로달러	1.072	1.082
유로원	1441	1467

전일 동향

Seoul 전일 종가 대비 1.90원 상승한 1350.60원에 개장한 달러원 환율은 개장 직후 미국 연준 주요 인사의 매파적 발언을 소화하며 상승 우위 흐름 이어갔으나 1350원 레벨 에서 고점 인식 네고물량 출현으로 상단이 제한되며 하락 전환함. 이후 중국 및 일본 당국의 통화 약세 개입 경계감 속 강세 흐름을 보인 아시아 통화에 연동하여 하락해 전일 종가 대비 2.50원 하락한 1346.20원에 거래를 마감함.

금일 전망

달러/원 간밤 달러원 환율은 ECB의 비둘기파적 발언을 소화하는 가운데, 미국 4분기 GDP 예상치를 상회하자 미국 금리 인하 기대감 후퇴하며 강세를 보인 달러화 영향으로 전일 종가 대비 3.80원 상승한 현물환 기준 1350원에 NDF거래를 마감함. 금일 서울외환시장에서의 달러원 환율은 미국, 호주 등 주요 국가 부활절로 휴일인 가운데 미국 2월 PCE 발표를 앞둔 경계감에 레인지 장세 보일 것으로 전망됨. 월말 수급을 소화하며 등락을 반복할 것으로 보이나, 1350원 레벨에서 네고물량 출현 가능성에 상단은 제한될 것으로 예상되며. PCE 발표 이후 방향성을 탐색할 것으로 보임.

예상범위 : 1344 ~ 1356원

달러/엔 지난 밤 달러엔은 글로벌 달러화 강세에도 보합세를 보이며 마감함. 미국 경제지표가 견조한 흐름을 보이며 미 금리인하 기대가 후퇴하며 글로벌 달러 강세가 유지되어 달러엔 하단이 지지됨. 34년만의 달러엔 최고치 근접에 따른 일본 외환당국 개입 경계감에 상단이 제한되며 151-152엔 레인지 장세가 지속되고 있음. 오늘 밤에 있을 미 PCE 지수와 파월 연준 의장의 발언 이후 달러엔 방향성이 나올 것으로 전망됨.

달러/엔 예상범위 : 150.9 ~ 151.9엔 | 엔/원(100) 예상범위 : 885원~899원

유로/달러 지난밤 유로달러는 견조한 미국 경제지표와 ECB위원의 비둘기파적 발언에 하락 마감함. 간밤에 나온 미 4분기 GDP 확정치가 상향되고, 주간 실업수당청구건수가 전주 대비 감소하는 등 미국 경제지표가 견조한 흐름 이어감. 반면 독일 2월 소매판매가 예상치를 하회하고 피에로 치폴로네 ECB 위원의 경제회복을 위한 금리인하 시사 발언에 약세를 보임. 금일 유로화는 미국 PCE 지수 경계감에 하락 우위 흐름 보일 것으로 전망됨.

유로/달러 예상범위 : 1.072~1.082달러 | 유로/원 예상범위 : 1,441원~1,467원

스왑시장

금리 스왑(IRS) 동향 및 전망

전일 전일 IRS 금리는 월러 연준 이사의 매파적인 발언 영향으로 아시아장에서 상승하는 미 금리에 동조하며 상승 출발 후, 장중 대외 금리 흐름과 국채 선물 매매 방향에 따라 제한적인 등락을 보이다가 전일 대비 보합 마감함.

금일 금일 IRS 금리는 간밤에 미 GDP 성장률이 예상치를 웃돌고 견조한 고용지표를 보이자 상승한 미 금리에 동조하며 상승 출발할 것으로 전망됨. 다만, 금일 밤 미 PCE 가격지수 발표를 대기하며 성 금요일 휴일을 맞아 변동성은 제한 될 것으로 판단됨.

통화 스왑(CRS) 동향 및 전망

전일 전일 CRS 금리는 장중 미 금리 상승에 동조하며 상승 출발하였음. 비드 우위 흐름에 대기하던 에셋스왑 물량이 출회하며 중장기 구간은 상승폭을 반납하였고 수급에 따른 등락 보이다가 커브 플래트닝 마감함.

금일 금일 CRS 금리는 성 금요일 휴일에 따른 일부 시장 휴장의 영향으로 적은 거래량 속 제한된 움직임을 보일 것으로 전망됨. 미 PCE 가격지수 발표를 앞두고 있어 뚜렷한 방향성은 부재한 채 수급에 따른 등락 보일 것으로 판단됨.

서울 외환시장

(단위 : 원)

구분	달러/원	위안/원
시가	1,350.60	186.22
고가	1,353.00	186.36
저가	1,342.90	185.37
종가	1,346.20	185.58
전일비	-2.50	-0.29
평균환율	1,346.80	185.75
NDF(1M)	1,346.25	
거래량	134(억불)	10(억위안)

주요 통화 환율

통화	환율	전일비
USD/KRW	1,346.20	-2.50
JPY/KRW	889.43	+0.70
EUR/KRW	1,457.13	-2.98
GBP/KRW	1,700.45	-0.80
AUD/KRW	878.33	-1.90
XAU/KRW	95,195.39	+739.06
USD/JPY	151.37	+0.05
EUR/USD	1.0787	-0.0039

금리 장외파생상품 (원화)

(단위 : %)

만기	IRS	전일비	CRS[1]	전일비
1Y	3.5150	+0.00	3.0350	+0.04
2Y	3.3675	+0.01	2.7800	+0.03
3Y	3.2850	+0.01	2.7450	+0.02
4Y	3.2575	+0.00	2.7500	+0.02
5Y	3.2400	+0.01	2.7050	+0.01
7Y	3.2300	+0.00	2.6700	+0.01
10Y	3.2375	+0.00	2.6200	+0.01

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

기준 금리 및 채권금리 (원화)

구분	종가	전일비
CD 91일물	3.64	+0.01
통안 1년	3.346	+0.01
통안 2년	3.354	+0.00
국고채 3년	3.293	+0.01
국고채 5년	3.324	+0.00
국고채 10년	3.377	+0.00
국고채선물(3년)	104.85	-0.04

단기 FX Swap Point (원화)

(단위 : 전)

만기	SWAP Point	전일비	Implied CRS
1M	-225	+0	3.35%
3M	-660	+0	3.31%
6M	-1,340	+0	3.27%
1Y	-2,620	-10	3.07%

금리 장외파생상품 (미국)

(단위 : %)

만기	국채	전일비	IRS[2]	전일비
1Y	5.021	+0.03	5.040	-0.00
2Y	4.626	+0.06	4.517	-0.02
3Y	4.416	+0.06	4.264	+0.06
5Y	4.219	+0.04	4.004	+0.03
10Y	4.205	+0.02	3.861	+0.03

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

주요 증시

증시	종가	전일비	
KOSPI	2,745.82	-9.29	-0.34%
미국 DOW	39,807.37	+47.29	+0.12%
중국 상해종합	3,010.66	-20.82	-0.69%
일본 NIKKEI 225	40,168.07	-594.66	-1.46%
영국 FTSE 100	7,952.62	+20.64	+0.26%

기타

종목	종가	전일비
WTI (선물)	83.11	+1.38
금 (선물)	2,254.80	+43.15
3M TERM SOFR	5.29823	-0.00368
3M EURIBOR	3.908	+0.00600
KOR 5Y CDS	38.63	+0.49

· 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.