2024년 4월 17일 (수)

DGB Daegu Bank

일일 외환시장 동향 및 전망

1. 전일 주요시장지표

항목	저가	고가	종가	전일비	최초고시	항목	종가	전일비	항목	종가	전일비
USD/KRW	1,387.20	1,400.00	1,394.50	10.50	1,395.30	3M CD	3.560	0.000	Dow	37,798.97	63.86
USD/JPY	153.89	154.78	154.75	0.47	901.91	3Y 국고채	3.470	0.033	Nasdaq	15,865.25	(19.77)
EUR/USD	1.0601	1.0654	1.0619	(0.0006)	1,481.88	10Y 국고채	3.627	0.070	Gold ($)	2,382.89	(0.30)
USD/CNY	7.2571	7.2821	7.2638	(0.0008)	191.99	10Y 미국채	4.672	0.064	WTI ($)	85.36	(0.05)

2. FX Market

항목	예상 거래범위		전일 종가	3일 최저	3일 최고	항목	예상 거래범위		전일 종가	3일 최저	3일 최고
USD/KRW	1,385.0	1,394.0	1394.5	1361.8	1386.3	USD/JPY	153.58	155.37	154.75	152.59	154.44
JPY/KRW	895.0	905.0	901.1	884.3	903.5	EUR/USD	1.0572	1.0677	1.0619	1.0620	1.0756
EUR/KRW	1,465.0	1,475.0	1480.8	1455.0	1476.1	USD/CNY	7.2427	7.2927	7.2638	7.2485	7.2687

USD / KRW SPOT

출처: Infomax

USD INDEX SPOT

출처: Infomax

서울외환시장

(전일동향) 1,387.20 ~ 1,400.00

달러원은 개장 초부터 외인순매도가 이어지며 상승압력을 받았으며 오전중 위안을 중심으로 아시아통화가 약세를 보이자 상승폭을 키우며 1400원에 고점을 형성함. 오후들어 1390원 후반에서 등락을 거듭하던 달러원은 매도 유입에 상승폭을 되돌리는 흐름을 보이다 장후반 당국의 구두개입성 발언에 급락하며 1390원중반에서 제한적인 움직임을 보였으며 1394.50에 종가를 형성함.

차액결제선물환(NDF)시장에서 달러-원 1개월물은 1387.95에 최종 호가됨. 최근 1개월물 스왑포인트(-2.35원)을 감안하면 전 거래일 서울외환시장 종가대비 4.20원 하락함.

(금일전망)

금일 서울외환시장은 역외 차액결제선물환(NDF)환율을 반영해 1,390원 부근에서 개장할 것으로 보임. 간밤 달러는 연준인사의 매파적인 발언에 강세를 보였으나 오름폭을 되돌리는 모습을 보였음. 달러원은 단기고점 확인 후 소폭하락하며 출발할 것으로 보임.

최근 환율 급등에 대한 당국 개입 경계감에 하방압력이 있을 것으로 예상되어 수급상 매도우위의 장세를 보이면서 1380원 후반을 중심을 등락할 것으로 예상됨.

국제금융시장

미증시는 이틀간의 급락세를 뒤로하고 단기 반등을 시도하였으나 약보합 혼조세로 마감. 대형 은행주의 약세가 시장 반등을 제한함.

미국채수익률은 파월 연준의장이 최근 일련의 인플레이션 지표 결과 금리 인하를 단행하기전에 시간이 더 필요함을 인정함에 따라 2년물이 5%를 넘는 등 작년 11월래 최고치를 기록함.

달러화는 미국채수익률 상승에 더해 중동 분쟁 격화로 안전통화 수요까지 가세하며 최근 들어 가장 강력한 매수세가 유입됨. 미국의 경기 호조로 IMF는 미국 경제성장률을 3.2%로 상향 조정. 실질적으로 1%대 성장에 머무는 주요국 대비 월등한 미국 경기 강세 상황이 반영된 결과. 전일의 파월의장의 매파발언까지 이어지며 6월 인하기대감은 소멸하는 분위기이고 달러 인덱스는 106.5까지 급등. 유로화는 일시적으로 1.06선을 하회하였고 매도 압력이 이어짐. 달러 대 엔화는 154.80까지 오르며 155엔선 턱밑까지 추격함.

3. Derivatives

(단위:원) (단위: %)

만기		1 개월	3개월	6개월	12개월	만기	1 년	2년	3년	5년
FX Swap Point	매입율	-3.30	-9.40	-18.70	-37.80	IRS(원화이자율스왑)	3.5450	3.5150	3.4925	3.4850
	매도율	-1.30	-4.40	-10.70	-21.80	CRS(USD/KRW통화스왑)	3.4150	3.2550	3.2550	3.2850

본 자료는 경제 및 투자여건에 대한 이해를 돕기 위한 정보제공 목적으로 작성, 배포되는 조사분석자료로서 오직 정보제공만을 목적으로 합니다. 따라서 위 자료는 참고자료로만 사용가능하며 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없스며 은행의 공식 입장은 아님을 유념하시기 바랍니다. 또한 본 자료는 당행의 사전동의 없이 복사, 대여, 재배포 될 수 없습니다.