2024년 4월 18일 (목)

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	1,382.60	1,390.80	1,386.80	(7.70)	1,386.30	3M CD	3.550	(0.010)	Dow	37,753.31	(45.66)
USD/JPY	154.16	154.76	154.39	(0.36)	898.36	3Y 국고채	3.465	(0.005)	Nasdaq	15,683.37	(181.88)
EUR/USD	1.0606	1.0680	1.0673	0.0054	1,479.46	10Y 국고채	3.625	(0.002)	Gold ($)	2,360.88	(22.01)
USD/CNY	7.2416	7.2678	7.2443	0.0014	190.83	10Y 미국채	4.593	(0.079)	WTI ($)	82.69	(2.67)

2. FX Market

항목	예상 거래범위		전일 종가	3일 최저	3일 최고	항목	예상 거래범위		전일 종가	3일 최저	3일 최고
USD/KRW	1,374.0	1,384.0	1386.8	1367.4	1400.0	USD/JPY	153.83	155.04	154.39	152.59	154.78
JPY/KRW	885.0	895.0	898.2	889.7	906.9	EUR/USD	1.0579	1.0726	1.0673	1.0601	1.0729
EUR/KRW	1,460.0	1,470.0	1480.1	1460.9	1485.7	USD/CNY	7.2250	7.2774	7.2443	7.2520	7.2821

USD / KRW SPOT

출처: Infomax

USD INDEX SPOT

출처: Infomax

서울외환시장

(전일동향) 1,382.60 ~ 1,390.80

달러원은 개장후 수급공방을 벌이며 1380원 후반대에서 등락을 거듭하였으나 위안화 절상고시 이후 위안화 강세에 연동하며 급락하였음. 1382.6원까지 저점을 낮춘 달러원은 저가 매수세 유입하며 하락폭을 되돌렸으며 1380원을 중심으로 횡보하였음. 오후장들어 국내증시 외인순매도에 달러원이 상승압력을 받으며 1386.8원에 종가를 형성함.

차액결제선물환(NDF)시장에서 달러-원 1개월물은 1377.50에 최종 호가됨. 최근 1개월물 스왑포인트(-2.30원)을 감안하면 전 거래일 서울외환시장 종가대비 7.00원 하락함.

(금일전망)

금일 서울외환시장은 역외 차액결제선물환(NDF)환율을 반영해 1,380원 부근에서 개장할 것으로 보임. 달러는 강달러 기조가 한풀 꺽이면서 간밤 약세를 보였음. 달러원은 당국이 개입가능성을 시사하면서 상단이 제한된 흐름을 보일 것으로 예상됨.

그러나 주 후반 예정되어있는 외인 배당 역송금수요 발생가능성과 금일 뉴욕증시 하락에 연동하며 국내증시 외인 순매도가 나올 가능성도 있음. 따라서 금일 달러원은 혼재된 재료속에서 제한된 하락세를 보이며 1370원 후반을 중심으로 등락할 것으로 예상됨.

국제금융시장

미증시는 이란 본토에 대한 이스라엘 공격 가능성에 약세를 보였고 미국채 수익률은 20년물의 강한 수요 확인으로 하락함.

글로벌 달러화는 파월의장의 고금리 장기화 가능성 언급이 주요국 중앙은행의 완화 정책 운용 여지를 제한하며 시장의 혼란을 지속적으로 야기하고 있으나 급등했던 달러화는 주말 주초를 거치며 다소 안정되었음.

그러나 미국과 중앙은행간 정책디커플링 우려는 상존. 유로화는 1.07선을 다시 시도하였고 달러/엔 및 원화 약세도 환율안정을 위한 한미일 재무장관 공동선언문이후 일시 안정을 찾는 분위기임.

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	-18.80	-38.10	IRS(원화이자율스왑)	3.5400	3.4950	3.4725	3.4775
	매도율	-1.30	-4.40	-10.80	-22.10	CRS(USD/KRW통화스왑)	3.4150	3.2550	3.2850	3.3550

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.