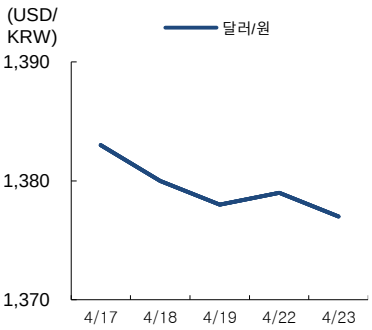
Daily

외환/금리스왑 동향 및 전망

2024-04-24

외환시장



딜러 전망치	예상레인지	
	저점	고점
달러원	1368	1378
달러엔	154.5	155.2
엔원	881	892
유로달러	1.065	1.073
유로원	1457	1479

전일 동향

Seoul 전일 종가 대비 0.3원 하락한 1378.9원에 개장한 달러원 환율은 연준 블랙아웃 기간으로 특별한 소재 부재한 가운데 수급에 따른 등락을 반복함. 이후 엔화 약세에 따른 일본 외환 당국의 구두 개입 및 수출업체 네고물량 출현으로 무거운 흐름 이어갔으나, 미국 4월 구매관리자지수 대기하며 큰 폭의 변동성 제한되며 전일 종가 대비 0.9원 하락한 1378.3원에 거래를 마감함.

금일 전망

달러/원 간밤 달러원 환율은 미국 4월 구매관리자지수 예상치를 하회한 가운데, 유로존 4월 구매관리자지수가 호조세를 이어가자 시현된 글로벌 달러 약세 흐름에 연동하여 전일 종가 대비 4.5원 하락한 현물환 기준 1373.8원에 NDF 거래를 마감함. 금일 서울외환시장에서 달러원 환율은 지정학적 리스크 다소 해소된 가운데 간밤 회복된 위험 선호에 하락 우위 흐름 이어갈 것으로 전망됨. 그러나 금일 밤 미국 3월 내구재 수주 발표를 앞두고 큰 폭의 변동성은 제한되며 약보합권에 머물 것으로 예상됨.

예상범위 : 1368 ~ 1378원

달러/엔 전일 달러엔 환율은 미 국채 수익률 하락세에도 불구하고 낙폭을 재차 되돌리면서 보합 마감. 미국 S&P PMI 지표가 예상치를 하회하자 미 국채 금리는 단기물을 중심으로 하락하며 커브가 스팁되었음. 엔화는 다른 통화들 대비 약세폭이 컸음. 금일 달러엔 환율은 일본은행 통화정책회의를 앞두고 당국 관련 뉴스가 상단을 제한하고 하단은 달러 매수세가 제한할 것으로 보임.

달러/엔 예상범위 : 154.5 ~ 155.2엔 | 엔/원(100) 예상범위 : 881원~892원

유로/달러 전일 유로달러 환율은 유럽 및 영국 PMI가 예상치를 상회하고 미국 PMI가 예상치를 하회하면서 급등함. 유로달러 환율은 한 달여 만에 가장 큰 폭으로 올랐음. 금일 유로달러 환율은 IFO 기업환경지수를 대기하면서 레인지 장세를 보일 것으로 전망. 미국 대형 기술주들의 실적 발표에 따라 전반적인 위험자산 움직임에 따라 등락할 것으로 전망.

유로/달러 예상범위 : 1.065~1.073달러 | 유로/원 예상범위 : 1457원~1479원

스왑시장

금리 스왑(IRS) 동향 및 전망

전일 전일 IRS 금리는 대외금리 연동하여 하락 흐름 보였음. 추가경정예산 편성 논의 가능성에 따른 장기물 수급 부담 우려 속 오전 20년물 국고채 입찰이 진행되었으나 일부 견조한 수요 보이며 금리 반등은 제한적이었음.

금일 금일 IRS 금리는 정치권 회담 가능성 및 추경 편성 여부 논의 가능성에 혼조세 보일 수 있을 것으로 판단. 다만 최근 채권시장 매수 수요 추가 유입시 상단은 제한될 수 있을 것으로 판단.

통화 스왑(CRS) 동향 및 전망

전일 전일 CRS 금리는 대외금리 연동하여 하락 출발하였으나 아시아 장중 미국 금리 소폭 반등 및 FX 스왑포인트 하락 일부 반납에 따라 단기 위주 반등 흐름 이어졌음. 중기 부채스왑 커버 수요도 일부 유입되었으나 에셋 스왑 유입에 따라 상승폭은 제한되었음.

금일 금일 CRS 금리는 대외금리 연동하여 혼조세 보일 것으로 예상됨. 다만 미국 금리 상단이 제한될 경우 CRS 금리 또한 부채스왑 커버 수요 완화시 상단은 제한될 것으로 판단. 단기 금리는 지정학적 리스크 변동에 연동할 것으로 판단.

서울 외환시장

(단위 : 원)

구분	달러/원	위안/원
시가	1,378.90	190.02
고가	1,379.70	190.19
저가	1,375.30	189.68
종가	1,378.30	189.92
전일비	-0.90	-0.34
평균환율	1,377.90	189.90
NDF(1M)	1,369.35	
거래량	113(억불)	175(억위안)

주요 통화 환율

통화	환율	전일비
USD/KRW	1,378.30	-0.90
JPY/KRW	890.52	-0.87
EUR/KRW	1,468.03	-2.75
GBP/KRW	1,701.37	-6.63
AUD/KRW	889.69	+2.45
XAU/KRW	102,033.48	-2,824.88
USD/JPY	154.82	-0.02
EUR/USD	1.0699	+0.0045

금리 장외파생상품 (원화)

(단위 : %)

만기	IRS	전일비	CRS[1)]	전일비
1Y	3.6025	-0.01	2.9850	-0.02
2Y	3.5425	-0.02	2.8200	+0.00
3Y	3.5050	-0.02	2.8150	+0.00
4Y	3.4950	-0.02	2.8350	-0.02
5Y	3.4900	-0.01	2.8850	-0.03
7Y	3.4850	-0.02	2.8500	-0.03
10Y	3.4950	-0.02	2.8100	-0.03

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

기준 금리 및 채권금리 (원화)

구분	종가	전일비
CD 91일물	3.560	+0.00
통안 1년	3.422	-0.01
통안 2년	3.499	-0.02
국고채 3년	3.489	-0.02
국고채 5년	3.556	-0.03
국고채 10년	3.625	-0.02
국고채선물(3년)	104.13	+0.07

단기 FX Swap Point (원화)

(단위 : 전)

만기	SWAP Point	전일비	Implied CRS
1M	-230	-20	3.46%
3M	-675	+5	3.33%
6M	-1,450	+20	3.22%
1Y	-2,980	+0	3.04%

금리 장외파생상품 (미국)

(단위 : %)

만기	국채	전일비	IRS[2)]	전일비
1Y	5.142	-0.02	5.185	-0.02
2Y	4.936	-0.04	4.833	-0.03
3Y	4.772	-0.03	4.617	-0.03
5Y	4.632	-0.02	4.378	-0.02
10Y	4.606	-0.00	4.225	-0.03

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

주요 증시

증시	종가	전일비	
KOSPI	2,623.02	-6.42	-0.24%
미국 DOW	38,503.69	+263.71	+0.69%
중국 상해종합	3,021.98	-22.62	-0.74%
일본 NIKKEI 225	37,552.16	+113.55	+0.30%
영국 FTSE 100	8,044.81	+20.94	+0.26%

기타

종목	종가	전일비
WTI (선물)	83.53	+1.44
금 (선물)	2,336.40	-8.10
3M TERM SOFR	5.32355	+0.00061
3M EURIBOR	3.891	-0.00100
KOR 5Y CDS	39.6	-0.53

· 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.