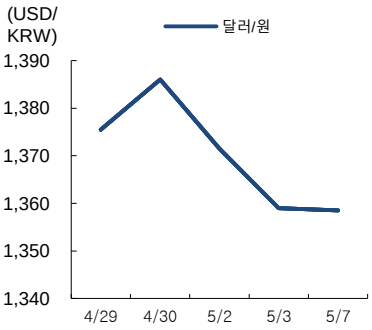
Daily

외환/금리스왑 동향 및 전망

2024-05-08

외환시장



딜러 전망치	예상레인지	
	저점	고점
달러원	1355	1365
달러엔	154.3	155.5
엔원	871	884
유로달러	1.070	1.077
유로원	1449	1470

전일 동향

Seoul 전일 종가 대비 6.3원 하락한 1,356.5원에 개장한 달러원 환율은 코스피가 외국인 순매수에 상승하며 하락하였으나 결제수요 유입에 반등함. RBA가 금리를 동결하고 엔화 및 위안화 약세에 점차 레벨을 높였고, 1,350원 후반대 좁은 레인지에서 수급에 따라 등락하다 전일 종가 대비 2.7원 하락한 1,360.1원에 거래를 마감함.

금일 전망

달러/원 간밤 달러원 환율은 미증시가 혼조세를 보이고 미국채 10년물 수익률 하락한 영향에 전일 종가 대비 0.8원 하락한 현물환 기준 1,359.3원에 NDF거래를 마감함. 금일 서울외국환시장에서 달러원 환율은 1,360원을 중심으로 레인지 장세 시현할 것으로 예상됨. 미 고용지표 둔화에도 금리인하 기대감이 제한되면서 하락압력 크지 않은 가운데 장중 큰 이벤트 부재속 국내증시 및 아시아통화에 연동하며 제한적인 흐름 보일 것으로 전망함.

예상범위 : 1355 ~ 1365원

달러/엔 전일 달러엔 환율은 간밤 美 미니애폴리스 연은 총재의 금리인상을 배제할 수 없다는 발언으로 올해 금리인하 기대가 엇갈리며 상승 마감함. 시장 기대보다 매파적인 발언으로 인해 장 초반 내려가던 달러화가 반등하고 미 국채금리도 반등함. 금일 달러엔 환율은 특별한 이벤트가 부재한 가운데 달러화 강세가 지속되며 엔화는 약세를 보일 것으로 예상됨.

달러/엔 예상범위 : 154.3 ~ 155.5엔 | 엔/원(100) 예상범위 : 871원~884원

유로/달러 전일 유로달러 환율은 장 초반 강세 흐름을 이어가다 연준 위원의 매파적인 발언으로 약세로 전환하며 하락 마감함. 간밤 미 연준위원의 매파적인 발언으로 인해 미국 증시가 혼조세를 보이고 미국채 금리도 상승함. 금일 유로달러 환율은 달러화 강세가 이어지는 가운데 위험자산 회피 흐름에 하방 압력이 우세할 것으로 예상됨.

유로/달러 예상범위 : 1.070~1.077달러 | 유로/원 예상범위 : 1449원~1470원

스왑시장

금리 스왑(IRS) 동향 및 전망

전일 전일 IRS 금리는 미 비농업고용지표가 시장의 기대에 부합하는 결과를 보이자, 금리 인하 기대감에 하락한 미 금리에 동조하며 하락 출발하였음. RBA 금리 동결 후 금리 인상 기대가 꺾이자 추가 하락하는 대외 금리에 연동하여 낙폭을 키우다 전일 대비 하락 마감하였음.

금일 금일 IRS 금리는 특별한 국내 재료 부재 속에 아시아 장에서의 미 금리 흐름 및 외국인 국채선물 매매 방향에 따라 제한적인 등락을 보일 것으로 전망됨. 미 국채 입찰에서 강한 수요가 확인 되었으나 연은 총재의 매파적인 발언이 뒤를 이어 혼조세를 보일 것으로 판단됨.

통화 스왑(CRS) 동향 및 전망

전일 전일 CRS 금리는 금리 인하 기대에 하락하는 대내외 금리 흐름에 동조하며 하락 출발 후 Fx-swap 레벨 상승 및 부채스왑 경계감에 하단이 지지되어 낙폭을 일부 되돌리며 전일 대비 소폭 하락 마감하였음.

금일 금일 CRS 금리는 특별한 방향성이 부재한 채 수급에 따른 등락을 보일 것으로 전망됨. 최근 확대된 스왑 베이시스로 인해 하락 압력이 우세할 것으로 보이나 기 발행 부채스왑 물량 해소를 위한 비드가 지속적으로 나오고 있어 하락폭은 제한될 것으로 판단됨.

서울 외환시장

(단위 : 원)

구분	달러/원	위안/원
시가	1,356.50	187.93
고가	1,360.10	188.32
저가	1,354.50	187.74
종가	1,360.10	188.31
전일비	-2.70	-1.01
평균환율	1,357.80	188.13
NDF(1M)	1,355.35	
거래량	109(억불)	129(억위안)

주요 통화 환율

통화	환율	전일비
USD/KRW	1,360.10	-2.70
JPY/KRW	880.07	-5.30
EUR/KRW	1,463.26	-3.25
GBP/KRW	1,705.70	-3.93
AUD/KRW	897.94	-3.15
XAU/KRW	101,407.55	+576.03
USD/JPY	154.69	+0.81
EUR/USD	1.0752	-0.0016

금리 장외파생상품 (원화)

(단위 : %)

만기	IRS	전일비	CRS[1]	전일비
1Y	3.5625	-0.02	3.0450	-0.02
2Y	3.4925	-0.05	2.9050	-0.03
3Y	3.4425	-0.06	2.9150	-0.02
4Y	3.4250	-0.06	2.8950	-0.02
5Y	3.4125	-0.07	2.9100	-0.04
7Y	3.4125	-0.07	2.8650	-0.04
10Y	3.4150	-0.07	2.8100	-0.04

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

기준 금리 및 채권금리 (원화)

구분	종가	전일비
CD 91일물	3.580	+0.00
통안 1년	3.413	-0.02
통안 2년	3.463	-0.04
국고채 3년	3.448	-0.05
국고채 5년	3.482	-0.07
국고채 10년	3.536	-0.08
국고채선물(3년)	104.33	+0.19

단기 FX Swap Point (원화)

(단위 : 전)

만기	SWAP Point	전일비	Implied CRS
1M	-225	+10	3.43%
3M	-665	+5	3.36%
6M	-1380	+10	3.33%
1Y	-2760	+60	3.10%

금리 장외파생상품 (미국)

(단위 : %)

만기	국채	전일비	IRS[2]	전일비
1Y	5.142	+0.01	5.154	-0.01
2Y	4.829	-0.00	4.741	-0.00
3Y	4.643	-0.00	4.497	-0.00
5Y	4.472	-0.01	4.235	-0.01
10Y	4.460	-0.03	4.078	-0.03

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

주요 증시

증시	종가	전일비	
KOSPI	2,734.36	+57.73	+2.16%
미국 DOW	38,884.26	+31.99	+0.08%
중국 상해종합	3,147.74	+7.02	+0.22%
일본 NIKKEI 225	38,835.10	+599.03	+1.57%
영국 FTSE 100	8,313.67	+100.18	+1.22%

기타

종목	종가	전일비
WTI (선물)	78.35	-0.59
금 (선물)	2,323.30	-10.50
3M TERM SOFR	5.32322	+0.00202
3M EURIBOR	3.824	-0.00300
KOR 5Y CDS	34.67	-1.14

· 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.