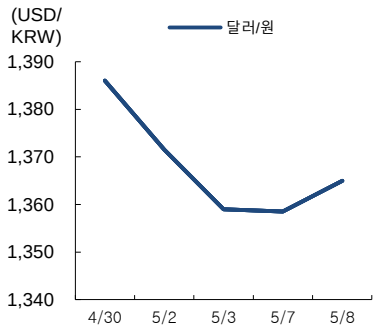
Daily

외환/금리스왑 동향 및 전망

2024-05-09

외환시장



딜러 전망치	예상레인지	
	저점	고점
달러원	1360	1370
달러엔	155.0	156.2
엔원	870	883
유로달러	1.070	1.076
유로원	1455	1474

전일 동향

Seoul 전일 종가와 동일한 1,360.1원에 개장한 달러원 환율은 간밤 연준 위원의 매파적 발언의 여파에 상승함. 국내증시 호조에도 역외매수세와 엔화 약세에 상승폭을 확대하였고, 장중 1,366.7원까지 속등하였으나 네고물량에 반락하였고, 장마감전 커스터디 추정 매도물량에 급락하여 전일 종가 대비 1.4원 상승한 1,361.5원에 거래를 마감함.

금일 전망

달러/원 간밤 달러원 환율은 미증시가 혼조세를 보였으나 미국채 10년물 입찰 수요 부진한 영향에 전일 종가 대비 3.8원 상승한 현물환 기준 1,365.3원에 NDF거래를 마감함. 금일 서울외국환시장에서 달러원 환율은 1,360원대에서 강보합권에 머물 것으로 예상됨. 비둘기파적이었던 FOMC 이후 연준 인사의 매파적인 발언에 금리인하 기대감 후퇴하며 하단이 지지되는 가운데 장중 큰 이벤트 부재속 제한적인 흐름 보일 것으로 전망하며 엔화 움직임에 주목해야할 것으로 보임.

예상범위 : 1360 ~ 1370원

달러/엔 전일 달러엔 환율은 글로벌 달러화 강세에 상승 마감함. 연준 위원의 매파적인 발언 이후 미국채 금리가 상승하고, 달러화가 재차 강세를 보이며 달러엔 환율도 상승함. 금일 달러엔 환율은 특별한 이벤트가 없는 큰 변동성은 제한될 것으로 예상되며 미국채 금리에 연동하여 흐름 보일 것으로 예상됨.

달러/엔 예상범위 : 155.0 ~ 156.2엔 | 엔/원(100) 예상범위 : 870원~883원

유로/달러 전일 유로달러 환율은 아시아장에서 약 보합흐름을 보이다 뉴욕장으로 넘어온 후 스웨덴이 금리 인하 발표를 하며 약세가 지속됨. 스웨덴이 금리 인하를 하며 유럽 중앙은행들의 금리 인하에 무게가 실리고 달러화 강세가 지속될 것으로 예상됨. 금일 유로달러 환율은 달러화 강세에 약세 흐름이 지속될 것으로 예상됨.

유로/달러 예상범위 : 1.070~1.076달러 | 유로/원 예상범위 : 1455원~1474원

스왑시장

금리 스왑(IRS) 동향 및 전망

전일 전일 IRS 금리는 최근 불확실성이 다소 해소되자 유입된 저가 매수세로 인해 하락흐름 보였음. 아시아 장에서 미 금리가 연은 총재의 매파적인 발언 후 소폭 상승하는 모습 보였지만, 양호한 국고채 입찰을 소화하며 전일 대비 소폭 하락 마감하였음.

금일 금일 IRS 금리는 연은 총재들의 연이은 매파적인 발언과 다소 약한 수요를 보인 미국채 10년물 입찰 결과로 인해 상승한 미 금리에 동조하며 상승 출발 후, BOE 금리 결정을 앞두고 외국인의 국채 선물 매매 방향에 따라 등락을 이어갈 것으로 전망됨.

통화 스왑(CRS) 동향 및 전망

전일 전일 CRS 금리는 구간별 수급에 따라 등락하는 흐름 보였음. 장초반 에셋 우위에 전구간 하락하는 모습 보이다가 중단기 구간 부채스왑 물량 해소를 위한 비드가 지속 출회하면서 하락폭을 되돌려 커브 플래트닝 마감하였음.

금일 금일 CRS 금리는 특별한 국내 재료 부재 속에 양방향 수급에 따른 제한된 등락 흐름 보일 것으로 전망됨. 대기하는 에셋 물량으로 하락압력이 우세할 것으로 보이나, 미 해소된 부채스왑 물량으로 하단은 지지될 것으로 판단됨.

서울 외환시장

(단위 : 원)

구분	달러/원	위안/원
시가	1,360.10	188.29
고가	1,366.70	189
저가	1,360.00	188.29
종가	1,361.50	188.58
전일비	+1.40	+0.27
평균환율	1,364.40	188.74
NDF(1M)	1,362.90	
거래량	138(억불)	119(억위안)

주요 통화 환율

통화	환율	전일비
USD/KRW	1,361.50	+1.40
JPY/KRW	877.40	-2.67
EUR/KRW	1,462.39	-0.88
GBP/KRW	1,700.24	-5.46
AUD/KRW	895.59	-2.34
XAU/KRW	101,357.41	-50.14
USD/JPY	155.48	+0.79
EUR/USD	1.0745	-0.0007

금리 장외파생상품 (원화)

(단위 : %)

만기	IRS	전일비	CRS[1]	전일비
1Y	3.5650	+0.00	3.0600	+0.02
2Y	3.4825	-0.01	2.9000	-0.00
3Y	3.4325	-0.01	2.8950	-0.02
4Y	3.4125	-0.01	2.8600	-0.04
5Y	3.4000	-0.01	2.8650	-0.04
7Y	3.3950	-0.02	2.8200	-0.05
10Y	3.4000	-0.02	2.7650	-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	3.398	-0.01
통안 2년	3.458	-0.00
국고채 3년	3.439	-0.01
국고채 5년	3.473	-0.01
국고채 10년	3.530	-0.01
국고채선물(3년)	104.37	+0.04

단기 FX Swap Point (원화)

(단위 : 전)

만기	SWAP Point	전일비	Implied CRS
1M	-225	+0	3.37%
3M	-680	-15	3.36%
6M	-1,380	+0	3.33%
1Y	-2,780	-20	3.10%

금리 장외파생상품 (미국)

(단위 : %)

만기	국채	전일비	IRS[2]	전일비
1Y	5.149	+0.01	5.155	+0.00
2Y	4.839	+0.01	4.751	+0.01
3Y	4.654	+0.01	4.512	+0.02
5Y	4.502	+0.03	4.262	+0.03
10Y	4.499	+0.04	4.115	+0.04

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

주요 증시

증시	종가	전일비	
KOSPI	2,745.05	+10.69	+0.39%
미국 DOW	39,056.39	+172.13	+0.44%
중국 상해종합	3,128.48	-19.26	-0.61%
일본 NIKKEI 225	38,202.37	-632.73	-1.63%
영국 FTSE 100	8,354.05	+40.38	+0.49%

기타

종목	종가	전일비
WTI (선물)	79.24	+0.89
금 (선물)	2,316.05	-7.25
3M TERM SOFR	5.32557	+0.00235
3M EURIBOR	3.788	-0.03600
KOR 5Y CDS	34.64	-0.03

· 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.