2024년 5월 9일 (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	1,360.00	1,366.70	1,361.50	1.40	1,364.40	3M CD	3.580	0.000	Dow	39,056.39	172.13
USD/JPY	154.52	155.68	155.53	0.83	877.12	3Y 국고채	3.437	(0.006)	Nasdaq	16,302.76	(29.80)
EUR/USD	1.0733	1.0757	1.0749	(0.0006)	1,466.53	10Y 국고채	3.532	(0.005)	Gold ($)	2,308.36	(5.88)
USD/CNY	7.2213	7.2336	7.2298	0.0060	188.74	10Y 미국채	4.499	0.037	WTI ($)	78.99	0.61

2. FX Market

항목	예상 거래범위		전일 종가	3일 최저	3일 최고	항목	예상 거래범위		전일 종가	3일 최저	3일 최고
USD/KRW	1,325.0	1,335.0	1361.5	1354.5	1382.3	USD/JPY	154.08	156.40	155.53	151.86	154.75
JPY/KRW	875.0	885.0	875.4	878.0	899.9	EUR/USD	1.0722	1.0771	1.0749	1.0721	1.0812
EUR/KRW	1,360.0	1,370.0	1463.4	1458.6	1476.5	USD/CNY	7.2159	7.2405	7.2298	7.1644	7.2267

USD / KRW SPOT

출처: Infomax

USD INDEX SPOT

출처: Infomax

서울외환시장

(전일동향) 1,360.50 ~ 1,366.70

개장 후 달러원은 엔화약세와 달러강세에 상승압력을 받으며 오전 중 1360원대 중반에 안착함. 1360원 중반대에서 오후내 횡보하던 달러원은 외국인 순매수 유입되며 국내증시가 상승하자 상승폭을 낮추었으며 장막판 대규모 매도로 추정되는 물량 유입되어 급락하며 1361.5원에 종가를 형성함.

차액결제선물환(NDF)시장에서 달러-원 1개월물은 1,363.00에 최종 호가됨. 최근 1개월물 스왑포인트(-2.30원)을 감안하면 전 거래일 서울외환시장 종가대비 3.80원 상승함.

(금일전망)

금일 서울외환시장은 역외 차액결제선물환(NDF)환율을 반영해 1,365.00원 부근에서 개장할 것으로 보임. 달러화는 시장의 금리인하기대가 후퇴하면서 강세를 보였음. 금일 달러원도 엔화 약세와 글로벌 달러강세의 영향으로 매수우위의 장세를 보일 것으로 예상됨. 미 증시도 혼조세를 보이면서 국내 증시가 리스크오프를 보일 경우 달러원에 상승압력을 더할 수 있음. 따라서 역내 수급을 소화하면서 제한적인 상승을 보일
것으로 예상됨.

국제금융시장

전일 미증시는 미정부의 대중국 반도체칩 수출 허가 취소로 인텔등 기술주 하락과 연준인사들의 매파발언 지속으로 약세를 보였음.

미국채수익률은 10년물 입찰 부진과 카시카리 총재 매파발언 여파등으로 5월 FOMC 이후의 피보팅 기대감이 약화되며 4.5%까지 상승하며 최근 저점 대비 9bp 가량 상승.

글로벌 달러화는 3일 연속 오르며 BOJ의 개입효과가 일주일만에 반감되었음. 당국의 구두개입과 무한 개입 경고 등 강경 발언이 이어졌으나 155엔선 중반까지 상승한 상황.

3. Derivatives

(단위:원) (단위: %)

만기		1 개월	3개월	6개월	12개월	만기	1 년	2년	3년	5년
FX Swap Point	매입율	-3.25	-9.30	-17.80	-35.80	IRS(원화이자율스왑)	3.5650	3.4825	3.4325	3.4000
	매도율	-1.25	-4.30	-9.80	-19.80	CRS(USD/KRW통화스왑)	3.4850	3.3300	3.3250	3.2950

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.