

Daily Forex Live

2023.2.23(목)

강달러 떡밥 vs 레벨에 대한 눈칫밥, 1,300원 중반 간보기

금일 달러/원 예상: 1,298~1,310원

NDF 종가: 1,302.00(스왑포인트 -1.45 고려 시 1,303.45원 전일비 -1.45)

시장평균환율(MAR): 1,303.80원

금일 전망: 당국 경계 속 글로벌 달러 강세, 위험선호 위축에 상승

상승요인: 매파적 FOMC 의사록이 초래한 강달러, 리스크 오프, 수입 결제

하락요인: 당국 미세조정 및 구두개입 경계, 수출 네고와 중공업 환헤지

오늘 달러/원은 매파적 FOMC 의사록 확인에 따른 달러 강세, 위험선호 위축 여파에 힘입어 하락 출발 후 제한적 상승 시도 예상. 시장이 가장 주목하는 이벤트 였던 FOMC 의사록 공개는 연준 위원 다수가 경기침체보다 인플레이션 위험 관리에 집중하겠다는 의지를 피력하면서 달러 강세 재료로 소화. 또한 위험자산에 대한 투심도 동시에 위축됨에 따라 국내증시 외국인 자금도 대규모 순매도를 기록할 가능성이 높으며 위험통화인 원화 약세 분위기를 조성. 이에 역외를 중심으로 한 통상리 회복이 수입업체 결제와 더불어 달러/원 상승을 주도할 듯.

다만 당국 미세조정 및 실개입 경계, 수출업체와 중공업 수주 물량은 상단을 지지. 이번 주 초 구두개입에 이어 외환당국이 어제 장 종료 후 시장관련 회의를 개최하면서 심리적 압박감으로 작용. 또한 수출업체 월말 네고와 연초 중공업 수주 호재로 대기 물량이 산적해 있다는 점도 공격적인 롱플레이 유입을 억제하는 요인. 따라서 오늘 소폭 하락 출발 후 증시 외국인 순매도, 수입 결제 유입에 상승압력이 우위를 보이며 1,300원 중반을 중심으로 제한적 상승 시도 전망.

전일 동향: 당국 경계감 고조, 상승 출발 후 1,300원 중반 횡보

전일 달러/원은 1,304.9(+9.0)원. 1,306.2원에 출발한 환율은 당국 미세조정 경계 속 수출 네고 유입에 상승폭을 축소. 또한 당국이 장마감 후 외환시장 회의를 진행할 예정이란 소식도 심리적 부담으로 작용. 오후 들어 양방향 수급을 소화하며 횡보하던 달러/원은 장 막판 역외 숏커버에 1,300원 중반에서장을 마감.

글로벌 동향: 달러화, 2월 FOMC 의사록 매파적 해석에 상승 마감

달러지수: 104.515(+0.339), 유로/달러 1.0605(-0.0043), 달러/엔 134.84(-0.17)

달러화는 2월 FOMC 의사록에 대한 매파적 해석에 힘입어 주요통화에 상승 마감.

FOMC 의사록에 따르면 연준은 지난 2월 참석자 대부분이 25bp 인상을 지지했으며 일부만 50bp를 주장. 다만 연준 정책 스탠스가 충분히 제약적이지 않다고 평가하면서 12월 점도표 최종금리 전망이 더 높아질 수 있음을 시사. 또한 미국 경기둔화, 침체보다 인플레이션 장기화를 더 우려하고 있는 것으로 확인.

미국 2년, 10년 국채금리는 저가매수 유입에 아시아, 유럽장에서 하락했지만 의사록 공개 후 장중 급등하며 낙폭을 축소. 달러화는 최근 지표 호조에 이어 의사록에 대한 매파적 평가까지 확인되자 주요 통화에 상승하며 104p 중반을 회복.

엔화는 미국 국채금리 급등세 진정, 글로벌 리스크 오프 분위기, 신임 BOJ 총재 지명자 청문회를 앞두고 강보합.

FX/Economist 민경원
eco_min1230@wooribank.com

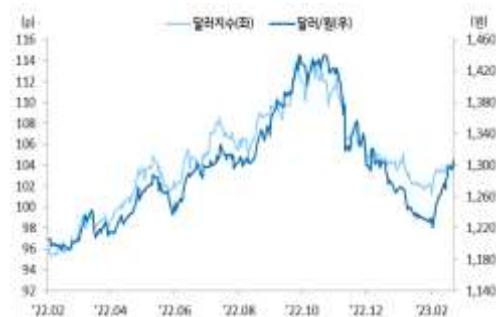
FX Sales/Marketer 신승연
syshin@wooribank.com

NDF 최종호가	저가	고가
1,301.90/1,302.10	-	-

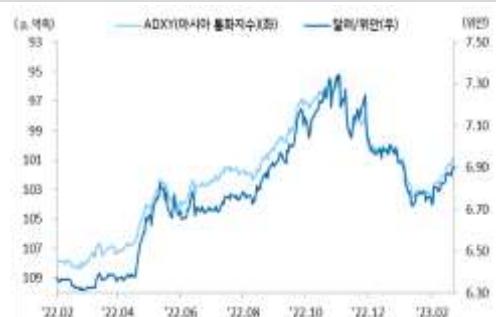
오늘 외환시장 주요 이벤트

18:30 영국 캐서린 만 BOE 위원 연설
19:00 유로 1월 CPI YoY(F)(예상 8.6%, 이전 8.5%)
22:30 미국 1월 시카고 연방국기활동(예상 -0.25, 이전 -0.49)
22:30 미국 4Q GDP QoQ(P)(예상 2.9%, 이전 2.9%)
22:30 미국 주간 신규 실업수당청구(예상 200k, 이전 194k)
N/A 한국 2월 금융통화위원회(예상 기준금리 동결)
00:50 미국 라파엘 보스틱 애틀란타 연은 총재 연설
01:00 미국 2월 캔자스시티 연은 제조업(예상 -3, 이전 -1)
04:00 미국 메리 데일리 샌프란시스코 연은 총재 연설

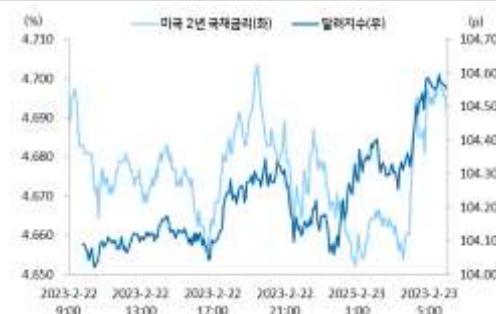
달러/원, 달러지수(vs G10)



매파적 2월 FOMC 의사록 공개에 아시아 통화 약세 부담 확대



2월 FOMC 의사록 매파적 해석에 장중 국채금리, 달러 급등



출처: 연합인포맥스, Bloomberg, 우리은행 트레이딩부

전일 SPOT 종가

(단위: 원, 억달러)

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비
USD/KRW	1,304.90	9.00	1,306.20	1,306.20	1,300.50	5.70	98.46	10.23
JPY/KRW	967.41	3.09	959.92	968.71	959.92	8.79	-	-
EUR/KRW	1,390.36	7.16	1,380.13	1,391.02	1,380.13	10.89	-	-
CNH/KRW	189.13	0.69	188.01	189.51	188.01	1.50	-	-

출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

주요통화 환율

아시아/신흥국 통화 환율

FX SWAP POINT

(단위: 원)

종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	만기	Mid	전일비
USD Index	104.515	0.339	0.57	USD/KRW	1,304.90	9.00	1.77	1M	(1.45)	(0.05)
EUR/USD	1.0605	(0.0043)	(0.79)	USD/SGD	1.3405	(0.0001)	0.34	2M	(3.45)	0.00
USD/JPY	134.84	(0.17)	0.51	USD/IDR	15202	12	(0.01)	3M	(5.35)	(0.05)
GBP/USD	1.2046	(0.0066)	0.13	USD/PHP	55.19	0.11	0.00	6M	(12.20)	(0.30)
USD/CNH	6.9038	0.0112	0.59	USD/RUB	75.4267	0.4788	1.20	12M	(26.10)	(0.60)
USD/CHF	0.9314	0.0036	0.82	USD/ZAR	18.2389	(0.0174)	1.15			
AUD/USD	0.6804	(0.0049)	(1.43)	USD/MXN	18.3562	(0.1121)	(1.23)			
NZD/USD	0.6218	(0.0004)	(1.00)	USD/PLN	4.4805	0.0189	0.62			
USD/CAD	1.3552	0.0014	1.18	USD/TRY	18.8509	(0.0193)	(0.01)			

출처: 블룸버그, 우리은행 트레이딩부 / 주: 뉴욕시장 종가 기준(한국시간 06:00)

IRS(vs 3M CD)

(단위: %, bp)

만기	Offer	Bid	Mid	전일비
1Y	3.820	3.785	3.803	2.50
2Y	3.705	3.675	3.690	1.50
3Y	3.610	3.580	3.595	2.00
4Y	3.565	3.530	3.548	3.25
5Y	3.540	3.510	3.525	4.00

한국/미국(SOFR) 단기금리

(단위: %, bp)

한국	종가	전일비	미국	종가	전일비
기준	3.50	0.00	기준	4.75	0.00
RP(7일)	4.20	0.00	1M	4.5746	1.37
CD	3.56	2.00	3M	4.8466	1.86
통안3M	3.518	0.60	6M	5.0954	2.97
통안1Y	3.635	2.10	12M	5.2648	4.20

CRS(vs 3M SOFR)

(단위: %, bp)

만기	Offer	Bid	Mid	전일비
1Y	3.489	2.891	3.190	1.50
2Y	3.498	2.892	3.195	2.00
3Y	3.472	2.868	3.170	1.50
4Y	3.439	2.831	3.135	2.50
5Y	3.459	2.851	3.155	3.00

국내시장 동향

(단위: p, %, bp)

외국인 증권투자 동향

(단위: 억원)

종목	주가/금리	전일비	종목	외인 순매수	5일누적
KOSPI	2,417.68	(41.28)	KOSPI	(1,912)	(2,983)
KOSDAQ	778.51	(14.91)	KOSDAQ	(3,035)	(1,272)
국고채3Y	3.623	(5.40)	국고채	5,834	8,761
국고채10Y	3.639	3.90	통안채	0	9,518

출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

글로벌 금융시장

(단위: p, %, bp, 달러, 달러/톤)

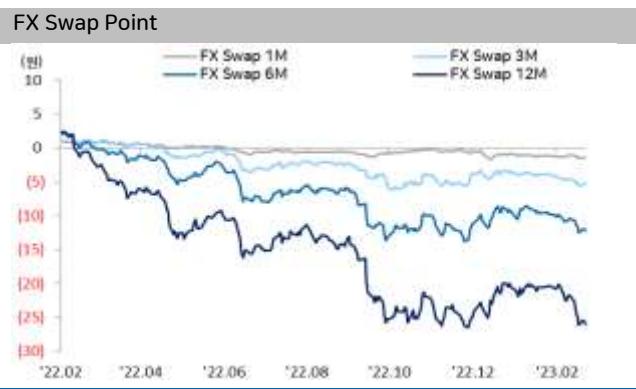
종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)	종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
Dow Jones	33,045.09	(84.50)	(0.26)	(3.17)	미국채 2Y	4.6933	(2.93)	(0.62)	1.35
S&P	3,991.05	(6.29)	(0.16)	(3.77)	미국채 10Y	3.9156	(3.69)	(0.93)	2.91
NASDAQ	11,507.07	14.77	0.13	(4.67)	WTI	73.95	(2.21)	(2.90)	(5.90)
EuroStoxx 50	4,242.88	(7.52)	(0.18)	(0.87)	Brent	80.47	(2.58)	(3.11)	(5.75)
DAX 30	15,399.89	2.27	0.01	(0.69)	구리	9,112.00	(88.50)	(0.96)	2.87
Nikkei225	27,104.32	(368.78)	(1.34)	(1.45)	니켈	26,431.00	(674.00)	(2.49)	1.10
Shanghai	3,291.15	(15.38)	(0.47)	0.32	대우	1,539.50	(9.25)	(0.60)	0.90
Hang Seng H	6,832.76	(92.31)	(1.33)	(2.64)	Gold	1,832.00	(1.00)	(0.05)	(0.12)

출처: 인포맥스, Bloomberg, 우리은행 트레이딩부

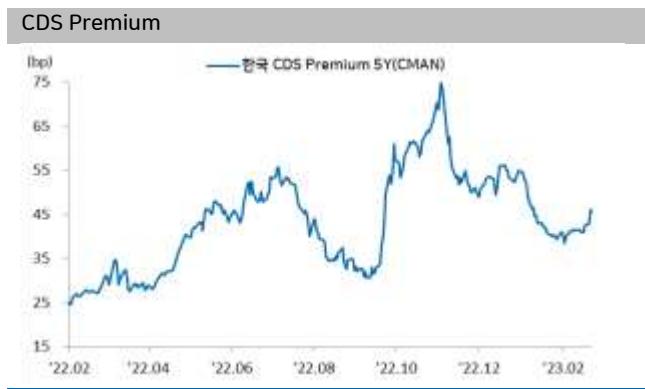
경제지표 및 이벤트

전일	금일	익일
16:00 독일 1월 CPI YoY(F)(8.7%, 예상 8.7% 부합)	07:30 미국 존 월리엄스 뉴욕 연은 총재 연설	09:01 영국 2월 GfK 소비자기대(예상 -43, 이전 -45)
18:00 독일 2월 IFO 기업 경기신뢰(91.1, 예상 91.2 하회)	18:30 영국 캐서린 만 BOE 위원 연설	16:00 독일 4Q GDP QoQ(F)(예상 -0.2%, 이전 -0.2%)
03:00 미국 5년 국채입찰	19:00 유로 1월 CPI YoY(F)(예상 8.6%, 이전 8.5%)	22:30 미국 1월 개인소득 MoM(예상 1.0%, 이전 0.2%)
04:00 미국 2월 FOMC 의사록 공개	22:30 미국 1월 시카고 연방국가활동(예상 -0.25, 이전 -0.49)	22:30 미국 1월 개인소비 MoM(예상 1.4%, 이전 -0.2%)
	22:30 미국 주간 신규 실업수당청구(예상 200k, 이전 194k)	22:30 미국 1월 PCE 가격 MoM(예상 0.5%, 이전 0.1%)
	N/A 한국 2월 금융통화위원회(예상 기준금리 동결)	22:30 미국 1월 근원 PCE 가격 MoM(예상 0.4%, 이전 0.3%)
	00:50 미국 라파엘 보스틱 애틀란타 연은 총재 연설	00:00 미국 1월 신규주택 판매 MoM(예상 0.7%, 이전 2.3%)
	01:00 미국 2월 캠브스시티 연은 제조업(예상 -3, 이전 -1)	00:00 미국 2월 미시간 소비자신뢰(F)(예상 66.4, 이전 66.4)
	04:00 미국 메리 데일리 샌프란시스코 연은 총재 연설	

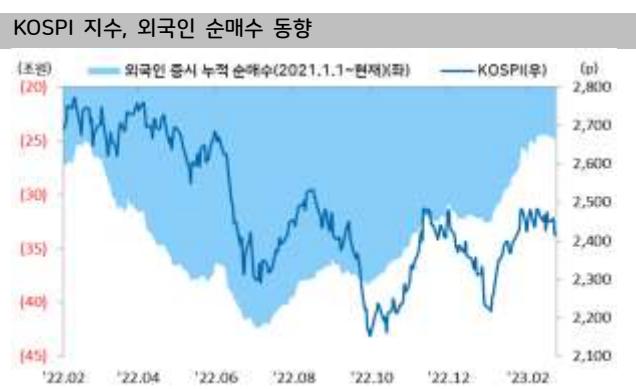
Chart



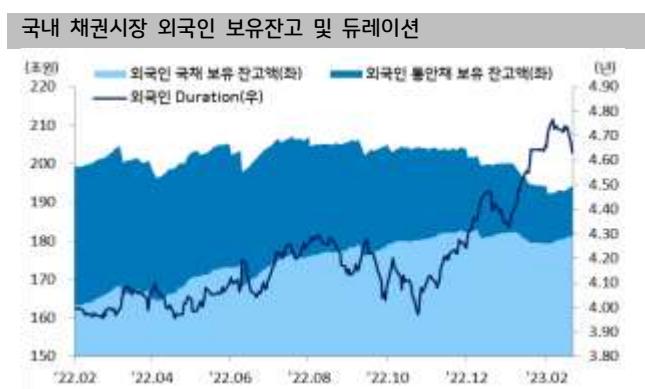
출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



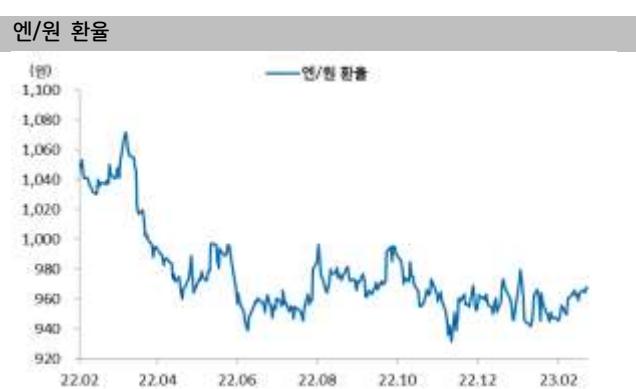
출처: Bloomberg, 우리은행 트레이딩부



처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



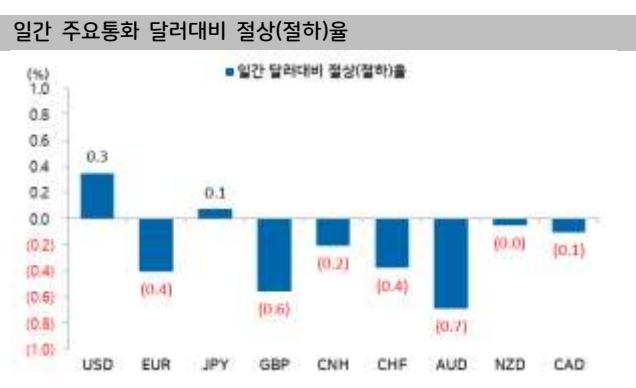
출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



출처: Bloomberg, 우리은행 트레이딩부



출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부 / 주: 뉴욕환시 증가 기준



출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부 / 주: 뉴욕환시 증가 기준

Compliance Notice

본 자료에 기재된 내용들은 작성자 본인의 의견을 정확하게 반영하고 있으며 외부의 부당한 압력이나 간섭 없이 작성되었음을 확인합니다(작성자: 민경원).

본 자료는 고객의 투자를 돋기 위한 목적으로 작성되었습니다. 본 자료에 수록된 내용은 당행이 신뢰할 만한 자료 및 정보를 바탕으로 작성한 것이나, 당행이 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없으므로 참고 자료로만 활용하시기 바라며 투자 시 투자자 자신의 판단과 책임하에 최종 결정을 하시길 바랍니다. 따라서 본 자료는 어떠한 경우에도 고객의 투자 결과에 대한 법적 책임 소재의 증빙자료로 사용될 수 없으며 직간접적 손실이 발생해도 당행은 책임을 지지 않습니다.

본 자료는 자본시장법 상 조사분석자료가 아니며 조사분석의 독립성을 확보하기 위한 법적 제한을 받지 않습니다. 또한 법령 상 허용되는 범위 내에서 당행이 본 자료에 언급된 통화 및 관련 금융상품 등을 거래하거나 관련 금융서비스를 제공할 수 있으며 이와 관련해 당행이 이해관계를 가질 수 있습니다.

본 자료에 기재된 의견은 예측에 불과하며 별도 통지 없이 변경될 수 있고 일정한 주기로 업데이트 되지 않을 수 있습니다.

본 자료는 어떠한 경우에도 당행의 사전동의 없이 복사, 인용, 배포, 전송, 대여 및 변경될 수 없습니다