



Daily Forex Live

2023년 11월 17일 금요일

레벨 부담에도 단기 저점 탐색,
1,290원 지지여부 확인

금일 달러/원 예상: 1,287~1,295원

NDF 종가: 1,290.40(스왑포인트 -2.10 고려 시 1,292.50원 전일비 -4.40)

시장평균환율(MAR): 1,303.90원

오늘 자 전망: 역내외 오퍼를 소화하며 1,290원 지지 여부 테스트

상승요인: 수입업체 결제를 비롯한 실수요 저가매수, 솟플레이 차익실현

하락요인: 위험선호 회복에 따른 커스터디 매도, 역내 수출업체 네고 소화

오늘 달러/원은 미국 국채금리 하락을 쫓아 1,290원 지지여부 테스트 예상. 어제 커스터디 매도와 네고 물량이 1,300원 하회를 주도하면서 달러/원 단기 하단을 확인하고자 하는 시장 니즈가 커질 확률이 높아. 당행은 1,280원까지 하단을 열어 두고 있으며 밤사이 미국 국채금리가 하락하면서 강달러 부담이 완화, 역내외 추격매도가 오늘 환율 하락을 주도할 것으로 판단. 또한 결과적으로 뉴욕증시가 소폭 상승하면서 위험선호 분위기도 크게 나쁘지 않다는 점을 감안하면 국내증시 외국인 자금 유입도 계속될 수 있으며 위험통화인 원화에 우호적인 재료.

다만 최근 하방 변동성 확대에 따른 반발매수, 국채금리 하락에도 달러가 크게 약세로 돌아서지 않아 솟포지션을 추가하기 부담스럽다는 점을 감안하면 1,280 후반에서는 지지를 받을 확률이 높아. 따라서 오늘 소폭 하락 출발한 뒤 중시 외국인 순매수로 인한 커스터디 매도, 역내 네고 유입에 낙폭 확대를 시도하겠으나 결제수요를 비롯한 저가매수에 막혀 1,290원을 중심으로 제한적인 하락 시도를 나타낼 전망.

어제 자동향: 역외 커스터디 매도와 수출 네고 유입에 하락 마감

전일 달러/원은 1,296.9(-3.9)원, 1,306원에 출발한 환율은 장 초반 매수세가 물리며 1,300원 후반까지 레벨을 높여. 오후 들어 위안화 약세가 주춤한 모습을 보이고 네고 물량이 유입되자 아래쪽으로 쓸림이 발생하며 상승폭을 전부 반납. 이후 커스터디 매도로 초점되는 역외 셀까지 붙으면서 장 막판 1,300원을 하회.

글로벌 동향: 달러화, 실업지표 부진에도 저가매수 유입에 보합 마감

달러지수: 104.388(-0.006), 유로/달러 1.0853(+0.0005), 달러/엔 150.73(-0.63)

달러화는 실업지표 부진에 따른 국채금리 하락에도 저가매수 유입에 보합으로 마감.

미국 주간 신규 실업수당 청구건수는 23.1만명으로 예상(+22.0만명)을 상회. 또한 연속 실업수당 청구건수도 186.5만명으로 컨센(184.3만명)을 웃돌아. 시장은 해당 지표를 고용시장 냉각 신호로 해석했으며 연준의 추가 인상 시나리오를 배제, 뉴욕장 초반까지 국채금리와 달러화 등반 하락으로 이어져.

엔화는 미국 국채금리 하락에 솟커버 물량을 소화하며 0.5% 상승해 달러 약세에 가장 크게 기여. 다만 뉴욕장 후반 달러 저가매수 유입에 상승폭을 일부 반납.

한편 국제유가는 성장둔화 우려, 재고증가 여파에 5% 가까이 급락하며 캐나다 달러, 노르웨이 크로네를 비롯한 원유 통화 약세로 연결. 미국 EIA 원유재고는 8월 이후 가장 높은 수준을 기록하고 현물인도 지역인 오클라호마 쿠싱 지역 재고도 증가한 것으로 확인.

FX Economist 민경원

eco_min1230@wooribank.com

오늘 외환시장 주요 이벤트

- 16:00 영국 10월 소매판매 MoM(예상 0.4%, 이전 -0.9%)
17:00 유로 빌누아 드 갈로 프랑스 중앙은행 총재 연설
17:30 유로 크리스틴 라가르드 ECB 총재 연설
18:00 유로 로버트 훌츠만 오스트리아 중앙은행 총재 연설
19:00 유로 10월 CPI YoY(F)(예상 2.9%, 이전 2.9%)
22:00 유로 요아힘 나겔 독일 중앙은행 총재 연설
22:30 미국 10월 건축허가 MoM(예상 -1.4%, 이전 -4.5%)
22:30 미국 10월 주택착공 MoM(예상 -0.6%, 이전 7.0%)

달러/원, 달러지수(vs G10)



달러/원 1, 2개월 리스크 리버설



실업지표 부진에 미국 국채금리, 달러 급락 후 달러만 반등



출처: 연합이포맥스 Bloomberg 월리은행 트레이딩룸

전일 SPOT 종가

(단위: 원, 억달러)

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비
USD/KRW	1,296.90	(3.90)	1,306.00	1,309.90	1,296.60	13.30	82.69	(47.72)
JPY/KRW	856.89	(6.63)	860.22	866.39	856.81	9.58	-	-
EUR/KRW	1,405.87	(8.65)	1,411.87	1,420.04	1,405.46	14.58	-	-
CNH/KRW	178.59	(0.92)	179.23	180.30	178.55	1.75	-	-

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	104.388	(0.006)	(1.44)	USD/KRW	1,296.90	(3.90)	(1.01)	1M	(2.10)	(0.05)
EUR/USD	1.0853	0.0005	1.73	USD/SGD	1.3471	(0.0033)	(0.98)	2M	(5.00)	(0.30)
USD/JPY	150.73	(0.63)	(0.41)	USD/IDR	15545	10	(0.70)	3M	(7.15)	0.20
GBP/USD	1.2415	(0.0001)	1.57	USD/PHP	55.78	(0.06)	(0.16)	6M	(14.30)	0.00
USD/CNH	7.2471	(0.0115)	(0.70)	USD/RUB	89.2713	(0.2383)	(2.81)	12M	(26.00)	0.00
USD/CHF	0.8887	0.0007	(1.57)	USD/ZAR	18.3719	0.1906	(1.54)			
AUD/USD	0.6471	(0.0038)	1.63	USD/MXN	17.2272	(0.0696)	(3.31)	한국 CDS Premium	(단위: bp)	
NZD/USD	0.5971	(0.0052)	1.31	USD/PLN	4.0301	(0.0194)	(3.12)	만기	Mid	전일비
USD/CAD	1.3755	0.0072	(0.38)	USD/TRY	28.6642	(0.0132)	0.67	5Y	34.005	(0.275)

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

IRS(vs 3M CD)

(단위: %, bp)

만기	Offer	Bid	Mid	전일비
1Y	3.865	3.835	3.850	(2.00)
2Y	3.755	3.720	3.738	(3.25)
3Y	3.680	3.645	3.663	(3.75)
4Y	3.650	3.615	3.633	(3.50)
5Y	3.625	3.590	3.608	(3.00)

한국/미국(SOFR) 단기금리

(단위: %, bp)

한국	종가	전일비	미국	종가	전일비
기준	3.50	0.00	기준	5.50	0.00
RP(7일)	3.70	0.00	1M	5.3311	0.15
CD	3.83	0.00	3M	5.3671	(0.23)
통안3M	3.595	0.00	6M	5.3750	(0.58)
통안1Y	3.672	0.10	12M	5.2369	0.75

CRS(vs 3M SOFR)

(단위: %, bp)

만기	Offer	Bid	Mid	전일비
1Y	3.426	2.824	3.125	(3.00)
2Y	3.257	2.653	2.955	(3.50)
3Y	3.261	2.659	2.960	(4.00)
4Y	3.246	2.644	2.945	(4.50)
5Y	3.268	2.662	2.965	(2.50)

국내시장 동향

(단위: p, %, bp)

종목	주가/금리	전일비	종목	외인 순매수	5일누적
KOSPI	2,488.18	1.51	KOSPI	4,560	9,745
KOSDAQ	811.11	1.75	KOSDAQ	(317)	3,605
국고채3Y	3.701	(4.30)	국고채	2,017	8,325
국고채10Y	3.799	(1.60)	통안채	(198)	0

출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부

글로벌 금융시장

(단위: p, %, bp, 달러, 달러/톤)

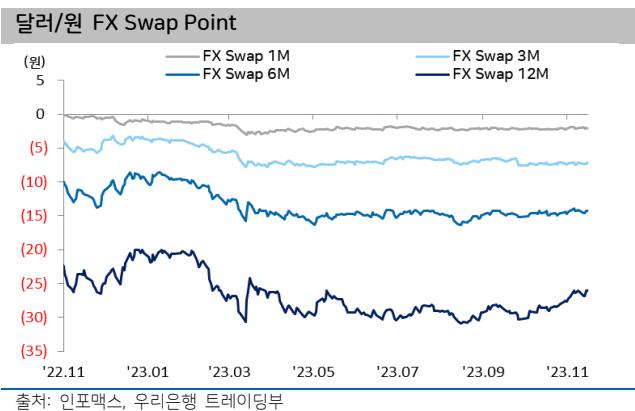
종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)	종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
Dow Jones	34,945.47	(45.74)	(0.13)	3.11	미국채 2Y	4.8354	(7.64)	(1.56)	(3.68)
S&P	4,508.24	5.36	0.12	3.70	미국채 10Y	4.4336	(9.78)	(2.16)	(4.12)
NASDAQ	14,113.67	9.84	0.07	4.38	WTI	72.91	(3.75)	(4.89)	(3.74)
EuroStoxx 50	4,302.45	(13.08)	(0.30)	1.73	Brent	77.48	(3.70)	(4.56)	(3.16)
DAX 30	15,786.61	38.44	0.24	2.83	구리	8,220.00	(45.50)	(0.55)	0.90
Nikkei225	33,424.41	(95.29)	(0.28)	2.38	니켈	17,020.00	(401.00)	(2.30)	(4.45)
Shanghai	3,050.93	(21.91)	(0.71)	(0.08)	대우	1,360.00	(25.00)	(1.81)	2.43
Hang Seng H	6,116.70	(87.52)	(1.41)	1.43	Gold	1,984.20	19.90	1.01	0.73

출처: 인포맥스, Bloomberg, 우리은행 트레이딩부

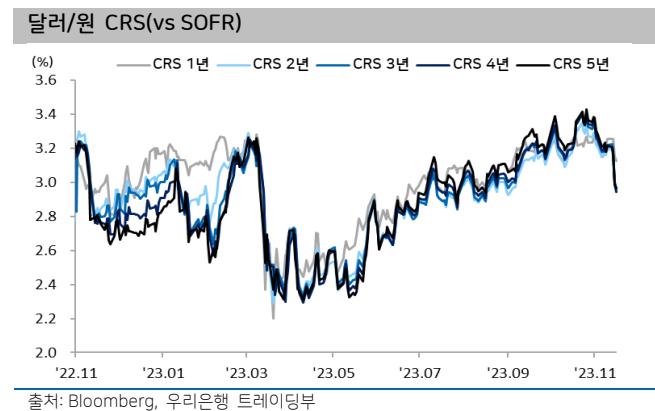
경제지표 및 이벤트

전일	금일	익일
09:30 호주 10월 실업률(3.7%, 예상 3.7% 부합)	16:00 영국 10월 소매판매 MoM(예상 0.4%, 이전 -0.9%)	10:15 중국 11월 1년 대출우대금리(예상 3.45%, 이전 3.45%)
22:30 미국 주간 신규실업수당청구(231k, 예상 220k 상회)	17:00 유로 빌누아 드 칼로 프랑스 중앙은행 총재 연설	00:00 미국 10월 CB 경기선행 MoM(예상 -0.6%, 이전 -0.7%)
22:30 미국 11월 필라델피아 연은 제조업(-5.9, 예상 -8.0 상회)	17:30 유로 크리스틴 라가르드 ECB 총재 연설	03:45 영국 앤드류 베일리 BOE 총재 연설
23:15 미국 10월 산업생산 MoM(-0.6%, 예상 -0.4% 하회)	18:00 유로 로버트 홀츠만 오스트리아 중앙은행 총재 연설	04:00 유로 빌누아 드 칼로 프랑스 중앙은행 총재 연설
23:25 미국 존 월리엄스 뉴욕 연은 총재 연설	18:15 유로 부이치자 크로아티아 중앙은행 총재 연설	
00:30 미국 크리스토퍼 월리 연준 의사 연설	19:00 유로 10월 CPI YoY(F)(예상 2.9%, 이전 2.9%)	
01:00 미국 11월 캔자스시티 연은 제조업(-2, 예상 -9 상회)	22:00 유로 요아힘 나겔 독일 중앙은행 총재 연설	
01:45 미국 로레타 메스터 클리블랜드 연은 총재 연설	22:30 미국 10월 건축허가 MoM(예상 -1.4%, 이전 -4.5%)	
02:00 미국 리사 루 연준 의사 연설	22:30 미국 10월 주택착공 MoM(예상 -0.6%, 이전 7.0%)	

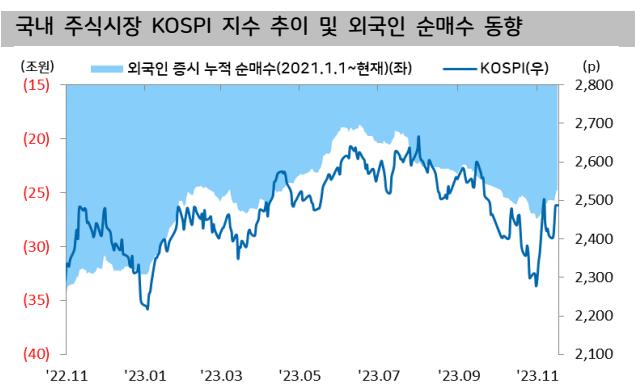
Chart



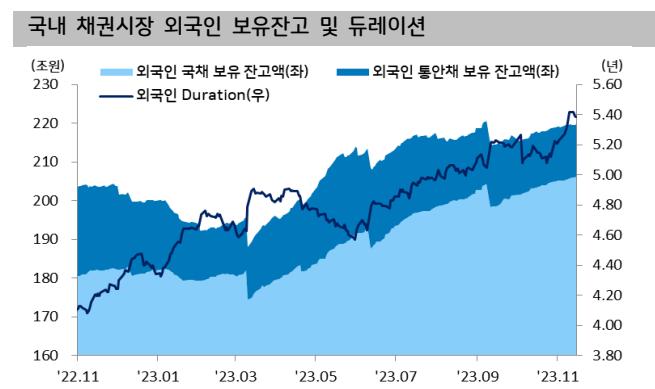
출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



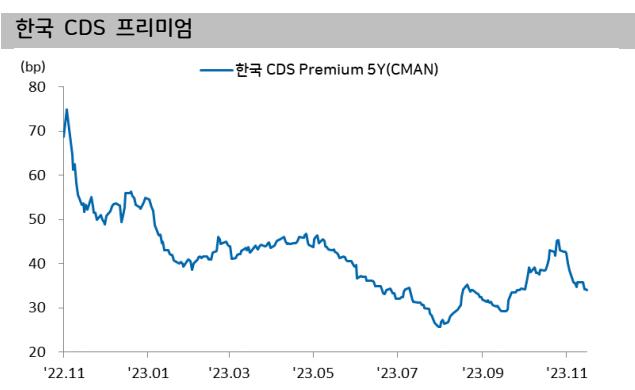
출처: Bloomberg, 우리은행 트레이딩부



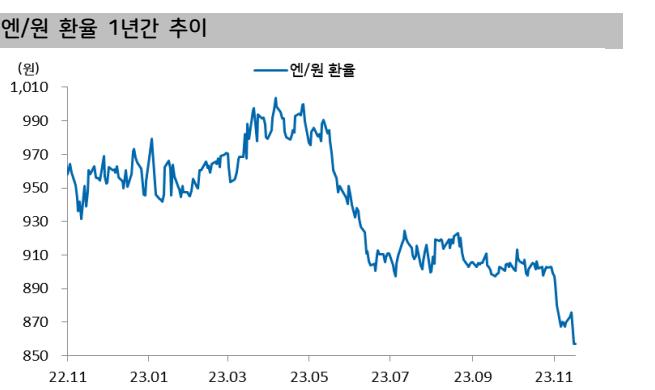
출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



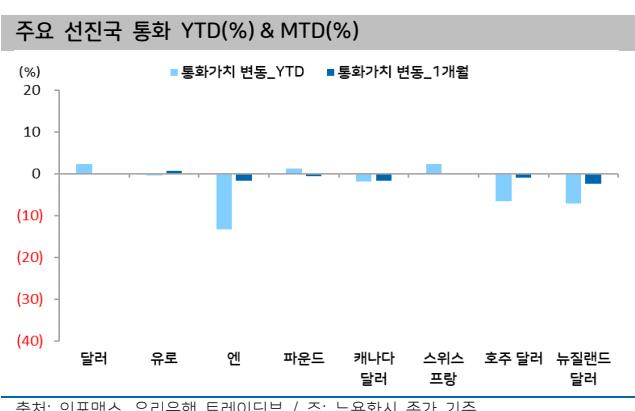
출처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



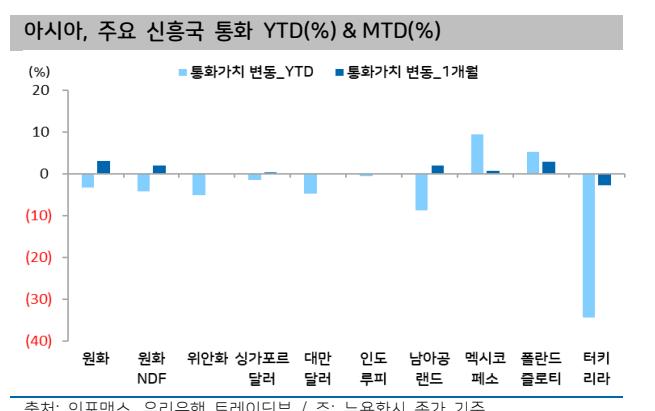
처: 인포맥스, 우리은행 트레이딩부



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