

## Daily Forex Live

2024년 2월 7일 수요일

## 증시부양 기대를 반영한 위안화 강세, 단기 솟플레이 운영 지지

금일 달러/원 예상: 1,320~1,330원

NDF 종가: 1,325.50(스왑포인트 -2.00 고려 시 1,327.50원 전일비 -0.10)

시장평균환율(MAR): 1,329.60원

### 오늘 자 전망: 위안화 강세를 쫓는 역외 솟플레이 유입에 하락 예상

상승요인: 수입업체 결제를 비롯한 실수요 저가매수 1,320원 초반 대기

하락요인: 중공업 수주 환해지, 위안화 강세에 연동된 역외 솟플레이 지속

오늘 달러/원은 증시부양 기대가 축발한 위안화 강세, 강달러 부담 완화에 하락 예상. 중국이 본격적인 금융시장 부양 움직임을 보여주면서 중국증시와 위안화 강세를 유도. 이에 1,340원 단기고점 인식 때문에 지난 이틀간 강달러를 제한적으로 추종하던 원화는 달러/위안 하락을 쫓아 레벨을 낮춰갈 것으로 기대. 또한 연이은 중공업 수주 소식도 연휴를 앞두고 네고 물량이 추가로 소화될 수 있다는 경계를 자극하는 재료이며, 역외에서 단기 포지션 운용을 계속 솟플레이로 가져가면서 하락압력 확대에 일조할 듯.

다만 수입 결제를 비롯한 달러 실수요 저가매수는 하단을 지지. 역내 수급에서 중공업 수주 때문에 연말이 지나갔음에도 수급이 달러 공급으로 기울어져 있지만 1,320원 초중반에서는 수입업체의 적극적인 매수대응이 관찰. 오늘도 장 초반부터 결제수요가 아래쪽을 받쳐줄 것으로 보이며 수출업체와 마찬가지로 연휴를 앞두고 환전 수요를 소화한다는 점을 감안했을 때 1,320원 초반에서 지지선을 형성할 공산이 커. 따라서 오늘 약보합 출발 후 위안화 동향에 주목하는 가운데 역외 솟플레이, 중공업 수주 환해지 수요에 1,330원 초중반 중심 등락 전망.

### 어제 자 동향: 캡업 출발 후 네고와 역외 매도에 상승폭 축소 마감

전일 달러/원은 1,327.6(-3.2)원. 1,334.4원에 출발한 환율은 장 초반 위안화가 강세를 보이자 역외 솟플레이가 따라붙으며 상승폭을 반납. 이후 1,330원 초반에서 결제수요 유입에 횡보했으나 오후 들어 중국 증시부양에 대한 기대가 위안화 급등으로 이어지자 한차례 더 낙폭을 키우며 1,320원 후반에서 장을 마감.

### 글로벌 동향: 달러화, 국채금리 하락에 연동되어 주요통화에 하락

달러지수: 104.172(-0.280), 유로/달러 1.0755(+0.0012), 달러/엔 147.94(-0.74)

달러화는 지역은행 주가 급락, 3년 입찰 호조로 인한 국채금리 하락에 약세로 마감.

뉴욕 커뮤니티 뱅코프가 지역은행이 보유한 상업용 부동산 대출에 대한 우려를 부추기면서 미국 지역은행 주가지수는 2% 가까이 급락. 이에 2년, 10년 국채금리는 미국장 개장 전부터 낙폭을 확대.

또한 수요일 420억 달러 규모의 10년 국채 입찰을 앞두고 3년 국채발행에서 수요가 양호한 모습을 보인 점도 금리 낙폭 확대에 일조, 달러화 약세를 주도.

한편 역외 위안화는 중국 당국의 증시 부양 기대에 증시와 동반 상승. 중국 국부펀드는 ETF 매입을 늘리겠다 밝혔고 증감위는 펀드에 본토 A주 보유 확대를 지도할 예정이라고 발표. 또한 시진핑이 금융당국과 금융시장에 대해 논의할 것인 언론 보도도 호재로 작용.

FX/Economist 민경원

eco\_min1230@wooribank.com

NDF 최종호가 저가 고가

1,325.30/1,325.70

-

-

### 오늘 외환시장 주요 이벤트

09:00 미국 패트릭 하거 필라델피아 연은 총재 연설  
16:00 독일 12월 산업생산 MoM(예상 -0.5%, 이전 -0.7%)  
22:30 미국 12월 무역수지(예상 -\$62.0b, 이전 -\$63.2b)  
01:00 미국 아드리아나 쿠글러 연준 이사 연설  
01:30 미국 수잔 콜린스 보스턴 연은 총재 연설  
02:30 미국 토마스 바킨 리치먼드 연은 총재 연설  
04:00 미국 미셸 보우만 연준 이사 연설

### 달러/원, 달러지수(vs G10)



### 달러/원 리스크 리버설 1M, 2M



### 지역은행 우려, 3년물 입찰 호조에 국채금리 급락, 달러 하락



출처: 연합인포맥스, Bloomberg, 우리은행 외환시장운용부

## 전일 SPOT 종가

(단위: 원, 억달러)

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비
USD/KRW	1,327.60	(3.20)	1,334.40	1,335.00	1,325.60	9.40	138.42	20.40
JPY/KRW	894.68	(2.69)	895.11	898.02	892.90	5.12	-	-
EUR/KRW	1,427.15	(8.03)	1,429.37	1,433.87	1,425.35	8.52	-	-
CNH/KRW	184.28	(0.25)	184.30	184.87	184.06	0.81	-	-

출처: 인포맥스, 우리은행 외환시장운용부

## 주요통화 환율

## 아시아/신흥국 통화 환율

## FX SWAP POINT

(단위: 원)

종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	만기	Mid	전일비
USD Index	104.172	(0.280)	0.75	USD/KRW	1,327.60	(3.20)	(0.14)	1M	(2.00)	0.00
EUR/USD	1.0755	0.0012	(0.83)	USD/SGD	1.3442	(0.0029)	0.37	2M	(4.30)	0.05
USD/JPY	147.94	(0.74)	0.22	USD/IDR	15730	25	(0.32)	3M	(6.55)	0.10
GBP/USD	1.2598	0.0062	(0.80)	USD/PHP	56.20	(0.09)	(0.37)	6M	(13.30)	(0.10)
USD/CNH	7.2014	(0.0187)	0.20	USD/RUB	90.6750	0.0471	1.03	12M	(25.90)	0.00
USD/CHF	0.8698	(0.0009)	0.93	USD/ZAR	18.8271	(0.2396)	0.15			
AUD/USD	0.6523	0.0040	(1.20)	USD/MXN	17.0373	(0.0782)	(0.68)			
NZD/USD	0.6098	0.0043	(0.62)	USD/PLN	4.0436	0.0017	0.79			
USD/CAD	1.3492	(0.0048)	0.70	USD/TRY	30.4878	(0.0589)	0.44			

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

## IRS(vs 3M CD)

(단위: %, bp)

만기	Offer	Bid	Mid	전일비
1Y	3.585	3.555	3.570	(1.75)
2Y	3.375	3.345	3.360	(1.75)
3Y	3.280	3.250	3.265	(1.75)
4Y	3.255	3.220	3.238	(1.25)
5Y	3.235	3.205	3.220	(1.00)

## 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	(3.00)	1M	5.3231	0.06
CD	3.67	0.00	3M	5.3226	0.65
통안3M	3.416	(0.80)	6M	5.2110	2.45
통안1Y	3.346	(1.30)	12M	4.9071	4.78

## CRS(vs 3M SOFR)

(단위: %, bp)

만기	Offer	Bid	Mid	전일비
1Y	3.172	2.618	2.895	(1.50)
2Y	2.921	2.349	2.635	1.00
3Y	2.877	2.313	2.595	2.50
4Y	2.844	2.286	2.565	2.50
5Y	2.827	2.263	2.545	2.50

## 국내시장 동향

(단위: p, %, bp)

종목	주가/금리	전일비	종목	외인 순매수	5일누적
KOSPI	2,576.20	(15.11)	KOSPI	3,320	35,617
KOSDAQ	807.03	(0.96)	KOSDAQ	(275)	(188)
국고채3Y	3.292	(2.00)	국고채	10,361	17,682
국고채10Y	3.382	0.80	통안채	0	2,767

출처: 인포맥스, 우리은행 외환시장운용부부

## 글로벌 금융시장

(단위: p, %, bp, 달러, 달러/톤)

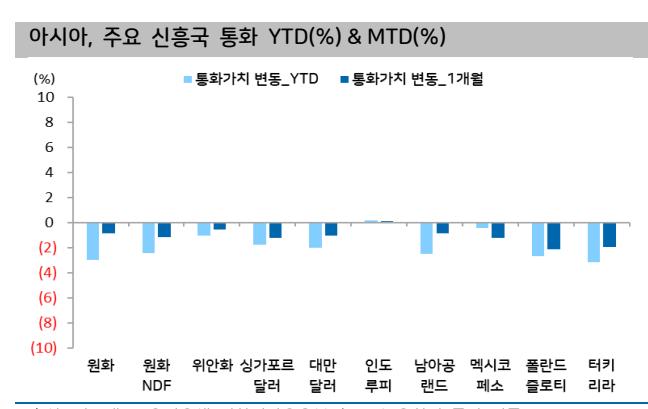
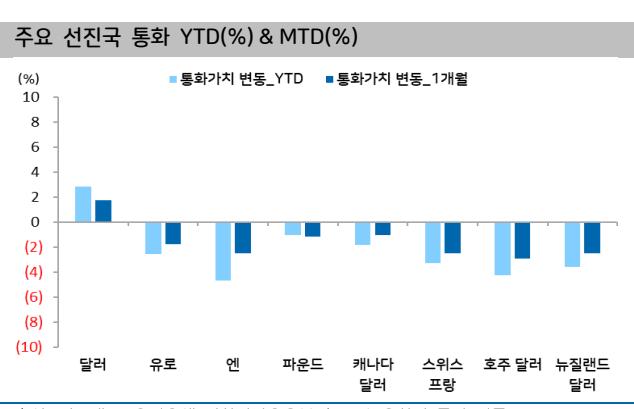
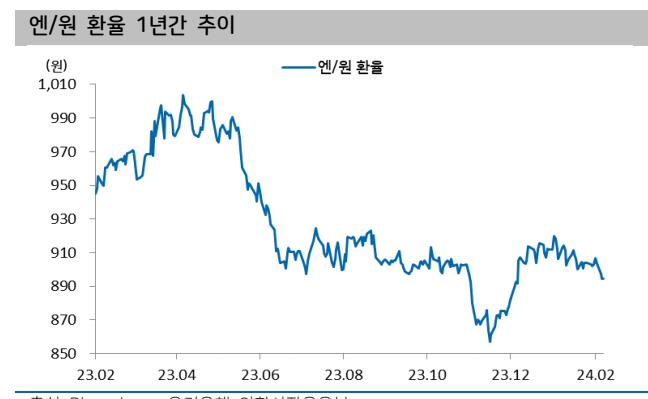
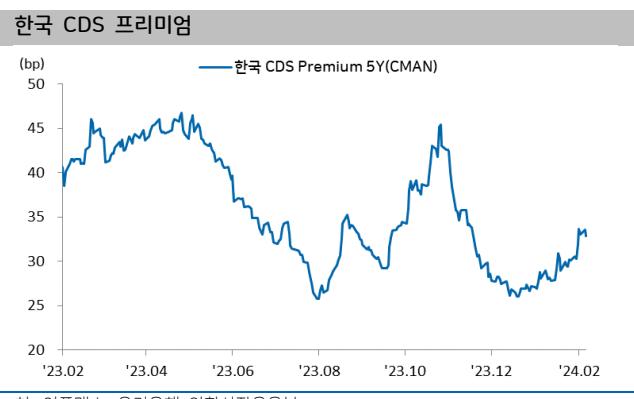
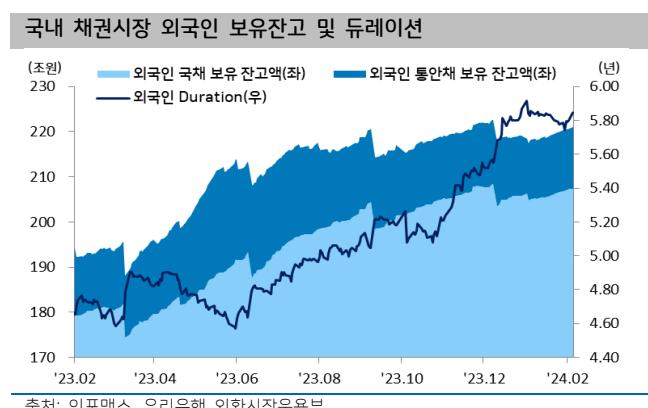
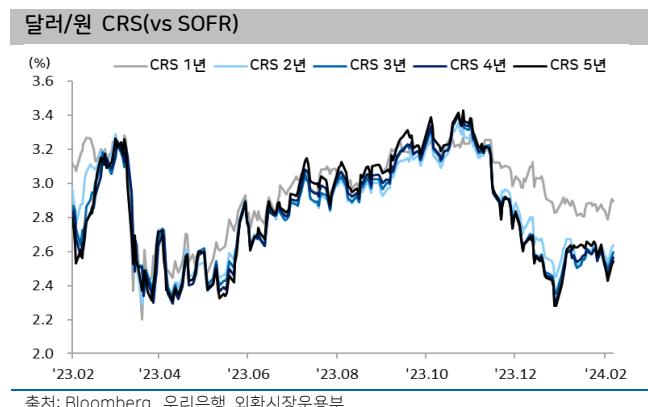
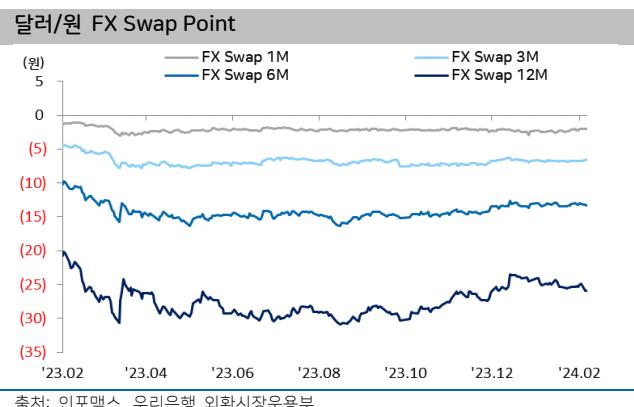
종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)	종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
Dow Jones	38,521.36	141.24	0.37	0.14	미국채 2Y	4.4035	(6.87)	(1.54)	1.59
S&P	4,954.23	11.42	0.23	0.59	미국채 10Y	4.1000	(5.79)	(1.39)	1.69
NASDAQ	15,609.00	11.32	0.07	0.64	WTI	73.31	0.53	0.73	(5.80)
EuroStoxx 50	4,690.87	35.60	0.76	0.60	Brent	78.62	0.63	0.81	(5.13)
DAX 30	17,033.24	129.18	0.76	0.36	구리	8,402.00	42.50	0.51	(2.47)
Nikkei225	36,160.66	(193.50)	(0.53)	0.26	니켈	15,927.00	(93.00)	(0.58)	(3.52)
Shanghai	2,789.49	87.30	3.23	(1.45)	대우	1,199.75	3.50	0.29	(1.56)
Hang Seng H	5,473.75	256.39	4.91	3.76	Gold	2,035.00	9.30	0.46	0.17

출처: 인포맥스, Bloomberg, 우리은행 외환시장운용부

## 경제지표 및 이벤트

전일	금일	익일
12:30 호주 2월 RBA 통화정책회의(기준금리 동결)	09:00 미국 패트릭 하커 필라델피아 연은 총재 연설	10:30 중국 1월 CPI YoY(예상 -0.5%, 이전 -0.3%)
16:00 독일 12월 제조업 주문 MoM(8.9%, 예상 -0.2% 상회)	16:00 독일 12월 산업생산 MoM(예상 -0.5%, 이전 -0.7%)	10:30 중국 1월 PPI YoY(예상 -2.6%, 이전 -2.7%)
19:00 유로 12월 소매판매 MoM(-1.1%, 예상 -1.0% 하회)	22:30 미국 12월 무역수지(예상 -\$62.0b, 이전 -\$63.2b)	19:45 유로 부이치치 크로아티아 중앙은행 총재 연설
02:00 미국 로레타 메스터 클리블랜드 연은 총재 연설	01:00 미국 아드리아나 쿠글리 연준 이사 연설	20:30 유로 피에르 블랑 벨기에 중앙은행 총재 연설
03:00 미국 낸 카시카리 미니애폴리스 연은 총재 연설	01:30 미국 수잔 콜린스 보스턴 연은 총재 연설	22:30 미국 토마스 바킨 리치먼드 연은 총재 연설
04:00 미국 수잔 콜린스 보스턴 연은 총재 연설	02:30 미국 토마스 바킨 리치먼드 연은 총재 연설	22:30 미국 주간 신규실업수당청구(예상 220k, 이전 224k)
	04:00 미국 미셸 보우만 연준 이사 연설	

## Chart



#### 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 하시기 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