

외환리포트

전일동향

전일대비 8.00원 상승한 1,233.10원에 마감

11일 환율은 전일대비 8.00원 상승한 1,233.10원에 마감했다.

이날 환율은 NDF 증가를 반영해 전 거래일 대비 4.90원 상승한 1,230.00원에 개장했다. 미국 인플레이션에 대한 우려에 갭업 출발한 환율은 네고물량에 잠시 1,230원을 하회하기도 했으나, 이내 상승폭을 확대했다. 이번 주 발표되는 미국 소비자물가지수(CPI)가 8%를 넘을 것으로 예상되며 아시아 시장에서 미 국채금리가 상승하고 달러화가 강세를 보인 영향이다. 배당금 관련 역송금 경계가 하단을 지지하는 가운데 달러화 강세 영향이 환율에 상방 압력을 가하면서 1,233.10원에 마감했다. 이날 아시아 시장에서 점심 무렵 10년 만기 미 국채금리는 2.78%대로 상승하였고 달러 인덱스는 100선까지 레벨을 높였다. 장중 변동 폭은 4.60원이었다. 한편, 이날 외환시장 마감시점의 엔-원 재정환율은 983.64원이다.

전일 달러 변동

시가	고가	저가	종가	평균환율
1230.00	1233.80	1229.20	1233.10	1232.00

전일 엔화 변동

시가	고가	저가	종가
984.64	989.71	980.04	982.10

전일 유로화 변동

시가	고가	저가	종가
1332.22	1348.04	1332.22	1341.96

F/X(달러-원) 스왑포인트

	1M	3M	6M	12M
보장환율(수출)	0.03	-0.04	-1.63	-6.95
결제환율(수입)	0.25	0.68	-0.51	-4.94

* 전일자 청약고객이 수취한 스왑포인트로 당일자 청약시에는 시장상황에 따라 변동

* 해당월 말일(영업일)까지의 스왑포인트 기준

* 자세한 사항은 환위험관리 지원센터 홈페이지(<https://www.ksure.or.kr/rh-fx/index.do>)에서 확인가능

금일 전망

미 3월 CPI 발표를 앞두고 위험선호 심리 훼손에...1,230원대 중반 중심 등락

NDF에서 환율은 스왑포인트(0.35원)를 고려하여 전 거래일 현물환 증가(1,233.10원) 대비 1.85원 상승한 1,235.30원에서 최종호가 됐다.

금일 환율은 미국의 3월 소비자물가지수(CPI) 발표를 앞두고 미 국채금리가 급등하며 위험선호 심리 훼손에 상승이 예상된다. 3월 CPI가 8%대 중반을 기록할 것이라는 전망이 나오면서 미국의 인플레이션 확인과 국채 금리 상승에 관심이 집중됐다. 전문가들은 미국의 CPI를 8.4%로 전망했는데 이는 1982년 이후 40여 년 만에 가장 높은 수치이다. 지난 2월 7.9% 상승한 점을 감안하였을 때 상승폭이 더 커졌다. 이와 같은 전망에 따른 인플레 우려에 미 국채 금리는 급등하였고, 10년 만기 미 국채금리는 7.26bp 상

승한 2.7822%로 장을 마쳤다. 연준 인사들의 매파적 발언도 금일 환율 상승에 압력을 가할 것으로 예상된다. 찰스 에반스 시카고 연방준비은행 총재는 연준이 다음 회의에서 50bp 금리 인상을 시행할 가능성이 매우 크다고 발언하였다. 다만, 네고 물량과 당국의 경계 심리는 상단을 제한할 것으로 예상된다.

금일 달러/원 예상 범위	1229.67 ~ 1238.33 원
체크포인트	■ 전일 외국인 주식 매매 동향 : -1343.01 억원
	■ 뉴욕 차액결제선물환율(NDF) : 전일 서울외환시장 현물환 대비 1.85원 ↑
	■ 美 다우지수 : 34308.08, -413.04p(-1.19%)
	■ 전일 현물환 거래량(종합) : 99.76 억달러
	■ 전일 외국인 채권매매 동향 : +6060 억원

주의사항

※본 리포트는 한국무역보험공사가 외부기관으로부터 획득한 자료를 인용한 것입니다.
※참고자료로만 활용하시기 바랍니다.