FX Market Daily

2024-03-12

전일동향

전일대비 9.50원 하락한 1,310.30원에 마감

11일 환율은 전일대비 9.50원 하락한 1,310.30원에 마감했다.
이날 환율은 NDF 1개월물 하락을 반영해 전 거래일 종가 대비 2.80원 하락한 1,317.00원으로 개장했다. 미국 2월 비농업 고용지표 등을 소화하며 하락 출발한 환율은 1,314원 부근까지 하락폭을 키웠다. 달러-엔과 달러-위안도 하락세를 보였다. 이날 개장 전 일본의 작년 4분기 GDP는 0.4% 상승해 예비치 -0.4%를 웃돌았다. 오후장에서 환율은 1,310원대 중반에서 주로 거래되었으나 중국 증시가 상승 폭을 확대하고 역외 달러-위안이 급락하자 함께 하락 폭을 키우며 1,310.30원에 최종 마감했다. 장중 변동 폭은 9.30원이었다.
한편, 이날 외환시장 마감시점의 엔-원 재정환율은 892.29원이다.

전일환율변동

구분	시가	고가	저가	종가	평균환율 (매매기준율)
달러	1317.00	1318.90	1309.60	1310.30	1314.40
엔화	897.42	899.55	890.45	891.63	-
유로화	1443.35	1445.31	1429.93	1431.44	-

* 시가/고가/저가/종가: 달러는 익일 06:00(美 서머타임 해제 시 익일 07:00) 기준, 엔화 및 유로화는 15:30 기준

F/X(달러-원) 스왑포인트

	1M	3M	6M	12M
보장환율(수출)	-1.45	-6.05	-13.17	-26.36
결제환율(수입)	-0.8	-5.18	-11.52	-23.22

* 해당월 최종영업일까지의 스왑포인트, 전일자 청약고객이 수취한 스왑포인트

* 당일 청약시 시장상황에 따라 변동하는 바, 자세한 사항은 환위험관리 지원센터(https://www.ksure.or.kr/rh-fx/index.do) 확인

금일 전망

위험선호심리 약화에... 1,310원 중심 등락 전망

NDF에서 환율은 스왑포인트(-2.40원)를 고려하여 전 거래일 현물환 종가(1,310.30) 대비 1.10원 상승한 1,309.00원에서 최종호가 됐다.
금일 환율은 미국 CPI 관망 속 위험선호 둔화에 상승 압력이 소폭 우위에 있을 것으로 예상된다. 달러화는 국채금리 상승에 엔화를 제외한 주요 통화에 강세를 보였다. 미국 2년 국채금리는 3년물 입찰수요가 견조했음에도 투자등급 회사채 물량 부담에 상승하며 달러 강세를 지지했다. 미 국채금리 2년 및 10년은 각각 6.00bp, 2.30bp 상승했다. 유로화는 로버트 홀츠만 오스트리아 중앙은행 총재가 4월 인하는 부정했으나 6월 인하에 우호적인 입장을 보이자 하락했다. ECB 내부에서 매파적 위원들이 인하 시점 특정에 동조하며 시장 기대를 자극했다. 뉴욕증시는 나스닥 및 S&P500지수가 기술주 조정으로 하락세를 보였다. 국내 증시에서는 외국인 자금 이탈이 이틀 연속 계속되며 수입업체 결제 수요와 함께 하단을 지지해 금일 상승 압력에 일조할 것으로 예상된다.
다만, 수출업체 네고물량 유입은 상단을 경직할 것으로 예상된다.

금일 달러/원 예상 범위

1306.50 ~ 1316.00 원

체크포인트

- ■ 전일 외국인 주식 매매 동향 : -1052.87 억원
- ■ 뉴욕 차액결제선물환율(NDF) : 전일 서울외환시장 현물환 대비 1.10원↑
- ■ 美 다우지수 : 38769.66, +46.97p(+0.12%)
- ■ 전일 현물환 거래량(종합) : 144.7 억달러
- ■ 전일 외국인 채권매매 동향 : +750 억원

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