FX Market Daily

2024-03-15

전일동향

전일대비 3.10원 상승한 1,317.60원에 마감

14일 환율은 전일대비 3.10원 상승한 1,317.60원에 마감했다.
이날 환율은 NDF 종가를 반영해 전 거래일 대비 0.30원 하락한 1,314.20원에 개장했다. 환율은 미국 2월 PPI와 소매판매 등을 경계하며 역외 매도가 주춤한 사이 결제수요가 유입하여 상승세를 견인했다. 이후 오후장 초반 달러인덱스와 역외 달러-위안이 상승하자 달러-원도 1,319원 부근까지 상승폭을 확대했으나 장 마감을 앞두고 상승폭을 일부 축소하며 1,317.60원에 마감했다. 장중 변동 폭은 5.80원이었다.
한편, 이날 외환시장 마감시점의 엔-원 재정환율은 890.89원이다.

전일환율변동

구분	시가	고가	저가	종가	평균환율 (매매기준율)
달러	1314.20	1319.00	1313.20	1317.60	1316.90
엔화	889.53	893.62	888.05	888.22	-
유로화	1438.92	1442.85	1433.42	1433.89	-

* 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)	-1.15	-5.67	-12.92	-26.64
결제환율(수입)	-0.75	-4.85	-11.28	-23.5

* 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

PPI 서프라이즈에...1,320원대 중반 중심 등락 전망

NDF에서 환율은 스왑포인트(-2.15원)를 고려하여 전 거래일 현물환 종가(1,317.60) 대비 6.55원 상승한 1,322.00원에서 최종호가 됐다.
금일 환율은 PPI 서프라이즈로 인한 달러 강세에 상승이 예상된다. 미국 2월 PPI, core PPI는 전월대비 0.6%, 0.3% 상승해 예상(+0.3%, 0.2%)을 크게 웃돌았다. 시장에서는 2월 CPI, PPI 상승으로 다음 FOMC에서 연준이 6월 인하 신호를 주지 않을 것이라는 우려가 부상함에 따라 강달러 분위기가 조성됐다. 이에 미국채 2년, 10년 금리는 각각 5.70bp, 10.00bp 급등하며 달러 상승을 지지했고, 달러인덱스는 103.369로 전장대비 0.56% 상승했다. 금일 달러원 환율 또한 연준의 금리인하 기대 위축을 반영하여 상승 압력이 우세할 것으로 전망된다. 또한, 달러-원이 하락할 때 매도세를 주도한 역외는 전날 미국 2월 PPI를 대기하며 매수세로 전환했고 간밤 지표 결과로 손절성 숏커버와 수입업체 저가매수가 유입되며 환율 상승 분위기에 일조할 것으로 예상된다
다만, 수출업체 월말 네고 조기 소화는 상단을 경직할 것으로 예상된다.

금일 달러/원 예상 범위

1319.00 ~ 1328.50 원

체크포인트

- ■ 전일 외국인 주식 매매 동향 : +4722.48 억원
- ■ 뉴욕 차액결제선물환율(NDF) : 전일 서울외환시장 현물환 대비 6.55원↑
- ■ 美 다우지수 : 38905.66, -137.66p(-0.35%)
- ■ 전일 현물환 거래량(종합) : 111.64 억달러
- ■ 전일 외국인 채권매매 동향 : -173 억원

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