FX Market Daily

2025-01-08

전일동향

전일대비 16.20원 하락한 1,453.50원에 마감

7일 환율은 오후 3시 30분 기준 전장대비 16.20원 하락한 1,453.50원에 마감했다.
이날 환율은 NDF 종가를 반영해 전 거래일 대비 9.40원 하락한 1,460.30원에 개장했다. 환율은 장초반 위안화 강세에 연동되어 낙폭을 확대했다. 오후장에서 환율은 국민연금 환 헤지로 추정되는 물량에 역내외 매도세가 지속되며 하락 흐름을 지속했고 1,453.50에 종가(15:30 기준)를 기록했다. 주간장중 변동 폭은 15.60원이었다.
한편, 이날 외환시장 마감시점의 엔-원 재정환율은 921.24원이다.

전일환율변동

구분	시가	고가	저가	종가	평균환율 (매매기준율)
달러	1460.30	1465.30	1444.50	1453.50	1455.40
엔화	932.38	932.91	914.76	920.66	-
유로화	1526.71	1527.85	1495.49	1503.54	-

* 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)	-1.36	-5.26	-12.81	-28.64
결제환율(수입)	-1.01	-4.38	-11.07	-25.21

* 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

美 지표 호조에...1,450원대 중후반 중심 등락 전망

NDF에서 환율은 스왑포인트(-1.70원)를 고려하여 전 거래일 현물환 종가(1,453.50) 대비 1.30원 상승한 1,453.10원에서 최종호가 됐다.
금일 환율은 미국 경제지표 호조가 촉발한 달러 강세에 상승 압력을 보일 것으로 예상된다. 미국 12월 ISM 서비스업 지수는 54.1pt로 예상(53.5pt) 및 전월치(52.1pt)를 모두 상회했다. 특히 하위 지표 중에 서비스업 가격 지수가 6.2pt 상승하며 인플레이션 우려를 자극했다. 또한, 11월 구인건수는 809.8만명으로 예상치(774.0만명)를 대폭 상회했다. Fedwatch에서 연준 1월 금리동결 확률은 일주일전 90.4%에서 지표 발표 이후 95.2%로 상승했다. 미 국채금리는 장단기물 일제히 상승했으며, 10년물 국채금리는 5.5bp 상승한 4.687%를 기록했다. 달러화는 전장대비 0.36% 상승한 108.65pt를 기록했다. 유로화, 엔화는 미국과의 금리차 확대에 따른 강달러 부담에 약세를 시현했다. 한편, 뉴욕증시는 엔비디아 실망 등 기술주 투매에 3대 지수 모두 하락했다. 금일 환율은 연준 금리인하 지연 우려 부상에 따른 달러 강세 전환에 상승 압력이 우세할 것으로 예상된다. 아울러 뉴욕증시 부진에 따른 위험선호 위축은 국내 증시 외국인 주식 순매도로 이어지며 환율 상승 분위기에 일조할 것으로 예상된다.
다만, 국민연금 전략적 환헤지 경계 등은 환율 상단을 제한할 것으로 예상된다.

금일 달러/원 예상 범위

1450.60 ~ 1460.20 원

체크포인트

- ■ 전일 외국인 주식 매매 동향 : +1586.56 억원
- ■ 뉴욕 차액결제선물환율(NDF) : 전일 서울외환시장 현물환 대비 1.30원↑
- ■ 美 다우지수 : 42528.36, -178.2p(-0.42%)
- ■ 전일 현물환 거래량(종합) : 91.98 억달러
- ■ 전일 외국인 채권매매 동향 : +400 억원

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