

보도자료

이 자료는 5월 3일(화) 조간부터 취급하여
주십시오. 단, 통신/방송/인터넷 매체는 5
월 2일(월) 12:00 이후부터 취급 가능

제 목 : 2016년 1/4분기중 외국환은행의 외환거래동향

- 2016년 1/4분기중 외국환은행의 일평균 **외환거래 규모**(현물환 및 외환파생상품 거래 포함)는 **529.9억달러***로 전분기(466.7억달러) 대비 63.2억달러 증가

* 거래규모로는 이제까지 최대수준이었던 2008.1/4분기중 528.5억달러를 경신

- 주요국 통화정책 완화기조에 대한 불확실성 등으로 환율변동성이 확대된 가운데 NDF 거래 및 현물환 거래가 크게 늘어난 데 기인

“자세한 내용은 ‘붙임’ 참조”

문의처 : 국제국 자본이동분석팀 과장 황문우, 팀장 이정욱

Tel : 759-5777, 5773 Fax : 759-5771 E-mail : bokdfai@bok.or.kr

공보관 : Tel : 759-4015, 4016

“한국은행 보도자료는 인터넷(<http://www.bok.or.kr>)에도 수록되어 있습니다.”



한국은행
THE BANK OF KOREA

(붙임)

2016년 1/4분기중 외국환은행의 외환거래 동향

□ 2016년 1/4분기중 외국환은행의 외환거래 규모(현물환 및 외환파생상품 거래를 포함, 일평균 기준)는 529.9억달러*로 전분기 대비 63.2억달러 증가

* 동 규모는 이제까지 최대수준이었던 2008년 1/4분기(528.5억달러)를 상회하는 사상 최대수준

■ 주요국 통화정책 완화기조에 대한 불확실성 등으로 환율변동성*이 증가한 가운데 NDF와 현물환 거래가 큰 폭으로 증가한 데 기인

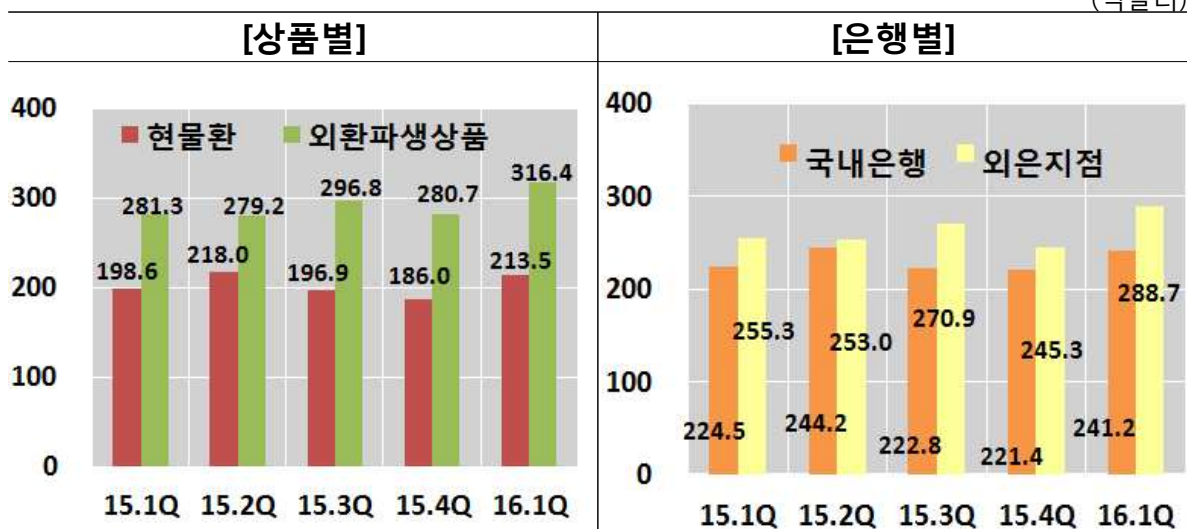
* 일중 환율변동폭(일중 최고가-최저가) : '15.4/4분기 6.3원 → '16.1/4분기 8.2원

○ (상품별) 현물환 거래규모는 213.5억달러로 전분기 대비 27.5억달러(14.8%) 증가하였으며, 외환파생상품 거래규모는 316.4억달러로 전분기 대비 35.7억달러(12.7%) 증가

○ (은행그룹별) 국내은행 거래규모는 241.2억달러로 전분기 대비 19.8억달러(8.9%) 증가하였으며, 외은지점의 거래규모는 288.7억달러로 43.4억달러(17.7%) 증가

외국환은행의 외환거래규모¹⁾

(억달러)



주: 1) 연중 일평균 총거래규모(매입+매도)

□ (현물환) 2016년 1/4분기중 현물환 거래규모(일평균)는 213.5억달러로 원/달러 거래를 중심으로 전분기 대비 27.5억달러(14.8%) 증가

- 통화별로는 원/달러 거래(160.5억달러)가 전분기대비 28.9억달러(21.9%) 증가하며 증가세를 견인
- 은행별로는 국내은행(+10.9억달러)과 외은지점(+16.5억달러)이 모두 증가하였으며, 거래상대방별로는 외국환은행간 거래(+16.7억달러)를 중심으로 증가

외국환은행의 현물환¹⁾ 거래규모

(일평균, 억달러, %)

		2015	1/4	2/4	3/4	4/4(A)	2016. 1/4(B)	B-A	증감률	추이 ⁶⁾
전 체		199.8	198.6	218.0	196.9	186.0	213.5	27.5	14.8	
통 화 별	KRW/USD	145.4	151.3	152.9	146.5	131.6	160.5	28.9	21.9	
	KRW/기타통화	30.2	19.6	37.9	28.3	34.7	28.4	-6.3	-18.1	
	KRW/CNY ²⁾	24.7	13.9	32.4	22.9	29.2	22.8	-6.3	-21.7	
	JPY/USD	5.8	8.2	6.4	4.7	4.1	7.7	3.6	88.9	
	USD/EUR	9.7	10.3	11.2	8.7	8.7	8.0	-0.6	-7.0	
	기타	8.6	9.1	9.6	8.7	7.0	8.9	1.9	27.3	
금 행 별	국내은행	112.5	112.1	126.5	106.1	105.4	116.3	10.9	10.4	
	외은지점	87.3	86.4	91.5	90.8	80.6	97.2	16.5	20.5	
거 래 상 대 방 별	외국환은행간 ³⁾	116.4	111.6	129.7	115.2	109.3	126.0	16.7	15.3	
	국내고객 ⁴⁾	41.4	41.7	41.6	42.0	40.5	47.3	6.9	17.0	
	비거주자 ⁵⁾	41.9	45.3	46.8	39.6	36.3	40.2	3.9	10.8	

주 : 1) 계약일로부터 2영업일 이내에 외환의 인수도(결제)가 이루어지는 거래

2) CNH를 포함하며 2015년부터 집계

3) 외국환은행간의 거래, "(매수+매도)/2" 기준

4) 외국환은행과 국내 개인 및 기업 등 국내고객간 거래

5) 외국환은행과 해외금융기관 및 해외고객간 거래

6) 최근 5분기 연속 분기별 일평균 거래규모 추이(이하 동일)

□ (외환파생상품) 2016년 1/4분기중 외환파생상품 거래규모(일평균)는 316.4억달러로 NDF 거래를 중심으로 전분기 대비 35.7억달러(12.7%) 증가

○ NDF 거래가(97.2억달러) 전분기 대비 27.4억달러(+39.3%) 증가하며 증가세를 견인*

* 1~2월중 국제유가 급락과 신흥국 금융불안 등에 따른 위험회피심리 증대로 비거주자들의 NDF 매수가 확대

외국환은행의 외환파생상품 거래규모

(일평균, 억달러, %)

		2015	1/4	2/4	3/4	4/4(A)	2016. 1/4(B)	B-A	증감률	추이
전 체		284.6	281.3	279.2	296.9	280.7	316.4	35.7	12.7	
상 품 별	선 물 환 ¹⁾	82.6	79.2	74.9	92.3	83.8	115.7	31.9	38.0	
	NDF	67.9	64.1	59.8	77.4	69.8	97.2	27.4	39.3	
	외환스왑 ²⁾	191.8	191.7	194.5	194.0	187.2	189.5	2.3	1.3	
	통화스왑 ³⁾	7.8	8.0	7.5	8.3	7.3	8.6	1.3	17.2	
	통화옵션 ⁴⁾	2.4	2.5	2.4	2.3	2.3	2.6	0.3	11.5	
통 화 별	KRW/USD	235.7	235.5	230.6	246.8	229.9	265.5	35.7	15.5	
	KRW/기타통화	5.8	6.6	5.5	5.1	6.2	6.3	0.1	2.1	
	KRW/CNY ⁵⁾	0.6	0.1	1.5	0.5	0.4	0.2	-0.3	-64.2	
	JPY/USD	11.1	9.9	11.5	10.1	12.8	11.3	-1.5	-11.7	
	USD/EUR	12.7	13.3	11.9	13.6	11.9	14.7	2.8	23.5	
	기타	19.3	16.1	19.7	21.3	20.0	18.6	-1.3	-6.7	
인 행 별	국내은행	115.8	112.4	117.7	116.8	116.1	124.9	8.8	7.6	
	외은지점	168.8	168.9	161.5	180.1	164.7	191.6	26.9	16.3	
거 래 대 상 별	외국환은행간	128.0	127.5	130.7	130.1	123.8	130.4	6.6	5.4	
	국내고객	43.8	45.9	43.4	43.5	42.3	48.3	6.0	14.2	
	비거주자	112.8	107.8	105.2	123.2	114.6	137.7	23.1	20.2	

주 : 1) 계약일로부터 일정기간 경과 후 미래의 특정일에 외환의 인수도(결제)가 이루어지는 거래
 2) 거래 양 당사자가 현재의 계약환율에 따라 서로 다른 통화를 교환하고, 일정기간 후 최초 계약시점에서 정한 선물환율에 따라 원금을 재교환하는 거래
 3) 거래 양 당사자가 현재의 계약환율에 따라 서로 다른 통화를 교환하고, 계약기간동안 상대통화의 이자를 교환한 후 만기시점에 당초의 원금을 재교환하는 거래
 4) 미래의 특정시점에 특정통화를 미리 약정한 가격으로 사거나 팔 수 있는 권리를 매매하는 거래
 5) CNH를 포함하며 2015년부터 집계

<참고>

부문별 외환거래 규모 동향

□ 은행별 외환거래 규모

(일평균, 억달러, %)

	2015					2016. 1/4(B)	B-A	증감률	추이
		1/4	2/4	3/4	4/4(A)				
국 내 은 행	228.2	224.5	244.2	222.8	221.4	241.2	19.8	8.9	
현 물 환	112.5	112.1	126.5	106.1	105.4	116.3	10.9	10.4	
외환파생	115.7	112.3	117.7	116.7	116.0	124.9	8.8	7.6	
외 은 지 점	256.1	255.3	253.0	270.9	245.3	288.7	43.4	17.7	
현 물 환	87.3	86.4	91.5	90.8	80.6	97.2	16.5	20.5	
외환파생	168.8	168.9	161.5	180.1	164.7	191.6	26.9	16.3	
합 계	484.3	479.8	497.2	493.7	466.7	529.9	63.2	13.5	

□ 거래상대방별 외환거래규모

(일평균, 억달러, %)

	2015					2016. 1/4(B)	B-A	증감률	추이
		1/4	2/4	3/4	4/4(A)				
외국환은행간 ¹⁾	244.4	239.1	260.3	245.3	233.1	256.4	23.3	10.0	
현 물 환	116.4	111.6	129.7	115.2	109.3	126.0	16.7	15.3	
선 물 환	7.9	5.8	6.0	9.5	10.1	15.0	4.9	48.7	
외환스왑	115.7	116.9	120.6	115.9	109.5	110.8	1.2	1.1	
통화스왑	4.1	4.6	3.8	4.5	3.6	4.3	0.7	19.1	
국 내 고 객 ²⁾	85.2	87.6	85.0	85.6	82.8	95.7	12.9	15.6	
현 물 환	41.4	41.7	41.6	42.0	40.5	47.3	6.9	17.0	
선 물 환	12.0	13.2	12.2	11.4	11.2	13.3	2.1	19.2	
외환스왑	28.7	29.7	28.1	29.0	27.9	31.2	3.3	11.9	
통화스왑	2.1	1.9	2.1	2.1	2.4	2.8	0.5	19.6	
비 거 주 자 ³⁾	154.7	153.1	151.9	162.8	150.9	177.9	27.0	17.9	
현 물 환	41.9	45.3	46.8	39.6	36.3	40.2	3.9	10.8	
선 물 환	62.8	60.2	56.6	71.4	62.6	87.4	24.8	39.6	
외환스왑	47.4	45.0	45.7	49.1	49.7	47.5	-2.2	-4.4	
통화스왑	1.5	1.4	1.7	1.7	1.3	1.4	0.1	7.6	
합 계	484.3	479.8	497.2	493.7	466.7	529.9	63.2	13.5	

주 : 1) 외국환은행간의 거래, "(매수+매도)/2" 기준

2) 외국환은행과 국내 개인 및 기업 등 국내고객간 거래

3) 외국환은행과 해외금융기관 및 해외고객간 거래