

보도자료

이 자료는 4월 27일(토) 조건부부터 취급하여
주십시오. 단, 통신/방송/인터넷 매체는 4월
26일(금) 12:00 이후부터 취급 가능

제 목 : 2024년 1/4분기중 외국환은행의 외환거래 동향

- 2024년 1/4분기중 외국환은행의 일평균 외환거래*(현물환 및 외환파생상품 거래) 규모는 694.0억달러로 전분기(633.1억달러) 대비 60.8억달러(+9.6%) 증가

* 일평균 매입 및 매도거래 규모의 합계

- 현물환(261.2억달러, +19.2억달러) 및 외환파생상품(432.8억달러, +41.7억달러) 거래 규모가 모두 증가

“자세한 내용은 ‘붙임’ 참조”

문의처 : 국제국 자본이동분석팀 과장 안주은, 팀장 이창현

<Tel> 759-5862, 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)

2024년 1/4분기중 외국환은행의 외환거래 동향

□ 2024년 1/4분기중 외국환은행의 일평균 외환거래(현물환 및 외환파생상품 거래) 규모는 694.0억달러로 전분기(633.1억달러) 대비 60.8억달러(+9.6%) 증가

○ 계절적 요인*에 더해 거주자 해외증권투자 및 외국인 국내증권투자 확대**, 환율 상승***에 따른 환위험 헤지 수요 등으로 증가

* 4분기 연말 북클로징에 따른 거래 축소 이후 1분기 거래 재개(최근 10년간 전년 4분기 대비 1분기 거래량은 평균 +12.0% 증가)

** 국내 투자자의 외화증권 결제액¹⁾(억달러) : 23.4분기 914 → 24.1분기 1,283
외국인의 월평균 증권 거래금액²⁾(조원) :: 23.4분기 182 → 24.1분기 216

주: 1) 매도금액+매수금액(한국예탁결제원 SEIBro)
2) 매도금액+매수금액. 24년은 1~2월중(금융감독원)

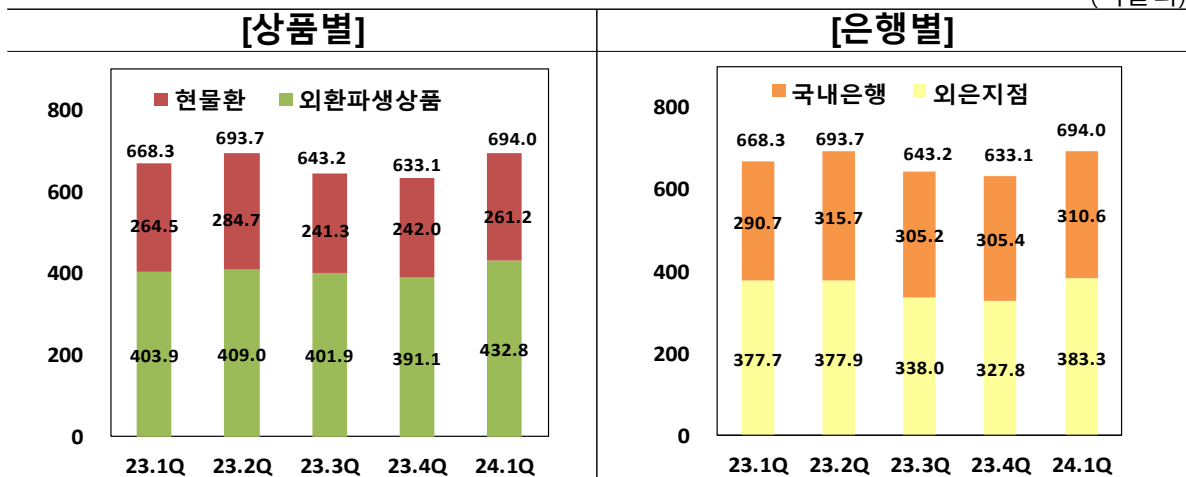
*** 원/달러 환율 : 23.4분기말 1,288 → 23.1분기말 1,347

— 상품별로는 현물환 거래규모가 261.2억달러로 전분기 대비 19.2억달러(+7.9%) 증가하였으며, 외환파생상품 거래규모는 432.8억달러로 전분기 대비 41.7억달러(+10.7%) 증가

— 은행별로는 국내은행의 거래규모가 310.6억달러로 전분기 대비 5.3억달러(+1.7%) 증가하였으며, 외은지점의 거래규모는 383.3억달러로 전분기 대비 55.6억달러(17.0%) 증가

외국환은행의 외환거래규모¹⁾

(억달러)



주: 1) 분기중 일평균 총거래규모(매입+매도)

□ (현물환) 2024년 1/4분기중 현물환 거래규모(일평균)는 261.2억달러로 전분기 대비 19.2억달러(+7.9%) 증가

- 통화별로는 원/달러 거래(188.9억달러)가 16.3억달러(+9.5%) 증가
- 은행별로는 국내은행의 거래(140.3억달러)가 6.4억달러(-4.4%) 감소한 반면 외은지점의 거래(120.9억달러)는 25.6억달러(+26.8%) 증가
- 거래상대방별로는 외국환은행의 상호거래(138.5억달러), 외국환은행의 국내고객(69.2억달러) 및 비거주자(53.5억달러)와의 거래가 각각 11.8억달러(+9.3%), 1.7억달러(+2.5%), 5.7억달러(+11.8%) 증가

외국환은행의 현물환¹⁾ 거래규모

(일평균, 억달러, %)

		2022	2023	1/4	2/4	3/4	4/4(A)	2024 1/4(B)	B-A (증감률)
전 체		231.3	258.1	264.5	284.7	241.3	242.0	261.2	19.2 (+7.9)
통 화 별	KRW/USD	173.2	185.1	189.0	199.0	180.0	172.5	188.9	16.3 (+9.5)
	KRW/기타통화	25.0	40.9	38.4	50.3	33.0	41.9	41.4	-0.5 (-1.3)
	KRW/CNY ²⁾	18.2	34.6	32.3	43.6	27.1	35.6	34.2	-1.4 (-4.0)
	JPY/USD	6.3	5.8	6.1	6.6	5.5	5.2	7.5	2.3 (+44.9)
	USD/EUR	13.4	12.1	15.2	12.3	10.1	10.7	9.8	-0.9 (-8.4)
	기타	13.5	14.2	15.8	16.5	12.7	11.7	13.6	1.9 (+16.7)
인 행 별	국내은행	122.7	147.1	142.9	157.8	141.1	146.7	140.3	-6.4 (-4.4)
	외은지점	108.7	111.0	121.5	126.9	100.1	95.4	120.9	25.6 (+26.8)
거 래 상 대 방 별	외국환은행간 ³⁾	102.5	134.2	134.0	152.1	124.1	126.7	138.5	11.8 (+9.3)
	국내고객 ⁴⁾	76.5	72.4	76.1	77.2	69.0	67.5	69.2	1.7 (+2.5)
	비거주자 ⁵⁾	52.3	51.5	54.4	55.4	48.2	47.9	53.5	5.7 (+11.8)

주 : 1) 계약일로부터 2영업일 이내에 외환의 인수도(결제)가 이루어지는 거래
 2) 역외 위안화(CNH)를 포함(2015년부터 집계)
 3) 외국환은행 간의 거래, "(매수+매도)/2" 기준
 4) 외국환은행과 국내 비은행금융기관, 기업, 개인 등 국내고객 간 거래
 5) 외국환은행과 해외금융기관 및 해외고객 간 거래

□ (외환파생상품) 2024년 1/4분기중 외환파생상품 거래규모(일평균)는 432.8억달러로 전분기 대비 41.7억달러(+10.7%) 증가

○ 선물환 거래(132.6억달러)는 NDF거래(+11.8억달러)를 중심으로 전분기 대비 14.8억달러(+12.6%) 증가

○ 외환스왑 거래(283.7억달러)는 외국환은행간의 거래(+15.3억달러)를 중심으로 전분기 대비 21.1억달러(+8.1%) 증가

외국환은행의 외환파생상품 거래규모

(일평균, 억달러, %)

		2022	2023	1/4	2/4	3/4	4/4(A)	2024 1/4(B)	B-A (증감률)
전 체		392.5	401.5	403.9	409.0	401.9	391.1	432.8	41.7 (+10.7)
상 품 별	선 물 환 ¹⁾	120.0	126.0	133.7	126.0	126.2	117.8	132.6	14.8 (+12.6)
	NDF	91.7	99.6	103.4	99.0	102.0	93.9	105.7	11.8 (+12.5)
	외환스왑 ²⁾	258.3	263.0	256.3	269.6	263.6	262.5	283.7	21.1 (+8.1)
	통화스왑 ³⁾	12.4	11.5	12.3	12.1	11.2	10.2	15.2	5.0 (+49.3)
	통화옵션 ⁴⁾	1.8	1.1	1.5	1.2	0.9	0.6	1.4	0.7 (+108.0)
통 화 별	KRW/USD	319.2	318.3	323.8	324.8	315.8	308.4	341.9	33.4 (+10.8)
	KRW/기타통화	8.0	9.3	10.7	9.3	8.8	8.5	9.2	0.8 (+9.1)
	KRW/CNY ⁵⁾	0.8	1.2	1.3	1.1	1.1	1.2	1.1	-0.1 (-10.7)
	JPY/USD	10.7	15.5	11.5	13.0	17.8	19.7	17.9	-1.8 (-8.9)
	USD/EUR	26.9	26.8	25.6	29.9	27.2	24.5	28.7	4.2 (+17.0)
	기타	27.7	31.6	32.1	32.0	32.2	30.0	35.1	5.0 (+16.7)
인 행 별	국내은행	143.7	157.1	147.7	157.9	164.1	158.7	170.4	11.6 (+7.3)
	외은지점	248.8	244.4	256.1	251.1	237.8	232.4	262.4	30.0 (+12.9)
거 대 상 대 방 면 별	외국환은행간	147.3	140.4	140.0	147.9	138.0	135.9	153.1	17.3 (+12.7)
	국내고객	88.0	87.6	90.6	86.9	85.8	87.1	91.6	4.5 (+5.2)
	비거주자	157.3	173.5	173.2	174.2	178.2	168.1	188.0	19.9 (+11.8)

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, 계약시 통화 간 이자율차가 반영된 선물환율에 따라 일정기간 후 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) 역외 위안화(CNH)를 포함(2015년부터 집계)

<참고>

부문별 외환거래규모 동향

□ 은행별 외환거래규모

(일평균, 억달러, %)

	2022	2023					2024 1/4(B)	B-A (증감률)	
			1/4	2/4	3/4	4/4(A)			
국 내 은행	266.4	304.2	290.7	315.7	305.2	305.4	310.6	5.3	(+1.7)
현 물 환	122.7	147.1	142.9	157.8	141.1	146.7	140.3	-6.4	(-4.4)
외환파생	143.7	157.1	147.7	157.9	164.1	158.7	170.4	11.6	(+7.3)
외 은 지 점	357.4	355.4	377.7	377.9	338.0	327.8	383.3	55.6	(+17.0)
현 물 환	108.7	111.0	121.5	126.9	100.1	95.4	120.9	25.6	(+26.8)
외환파생	248.8	244.4	256.1	251.1	237.8	232.4	262.4	30.0	(+12.9)
합 계	623.8	659.6	668.3	693.7	643.2	633.1	694.0	60.8	(+9.6)

□ 거래상대방별 외환거래규모

(일평균, 억달러, %)

	2022	2023					2024 1/4(B)	B-A (증감률)	
			1/4	2/4	3/4	4/4(A)			
외국환은행간¹⁾	249.8	274.6	274.0	300.0	262.0	262.6	291.6	29.1	(+11.1)
현 물 환	102.5	134.2	134.0	152.1	124.1	126.7	138.5	11.8	(+9.3)
선 물 환	12.1	15.9	16.4	18.2	15.1	14.0	14.5	0.5	(+3.6)
외환스왑	129.1	119.2	118.2	124.3	117.7	116.5	131.9	15.3	(+13.2)
통화스왑	6.0	5.3	5.4	5.4	5.1	5.3	6.7	1.4	(+25.7)
통화옵션	0.1	0.0	0.1	0.0	0.0	0.0	0.1	0.0	(+347.5)
국 내 고 객²⁾	164.4	160.0	166.8	164.0	154.7	154.6	160.8	6.2	(+4.0)
현 물 환	76.5	72.4	76.1	77.2	69.0	67.5	69.2	1.7	(+2.5)
선 물 환	22.9	19.1	22.5	17.7	18.3	17.7	19.9	2.2	(+12.3)
외환스왑	60.8	65.0	63.7	65.5	63.8	67.0	66.1	-1.0	(-1.4)
통화스왑	3.3	2.9	3.5	2.9	3.1	1.9	4.9	3.0	(+158.9)
통화옵션	1.0	0.6	0.9	0.7	0.5	0.4	0.7	0.3	(+60.7)
비 거 주 자³⁾	209.6	224.9	227.6	229.6	226.4	216.0	241.6	25.6	(+11.8)
현 물 환	52.3	51.5	54.4	55.4	48.2	47.9	53.5	5.7	(+11.8)
선 물 환	85.0	90.9	94.8	90.1	92.8	86.0	98.1	12.1	(+14.1)
외환스왑	68.4	78.8	74.4	79.9	82.1	79.0	85.7	6.8	(+8.6)
통화스왑	3.2	3.3	3.4	3.8	3.0	3.0	3.6	0.6	(+21.0)
통화옵션	0.7	0.4	0.6	0.5	0.4	0.2	0.6	0.4	(+181.8)
합 계	623.8	659.6	668.3	693.7	643.2	633.1	694.0	60.8	(+9.6)

주 : 1) 외국환은행 간의 거래, "(매수+매도)/2" 기준
 2) 외국환은행과 국내 개인 및 기업 등 국내고객 간 거래
 3) 외국환은행과 해외금융기관 및 해외고객 간 거래