

보도자료

이 자료는 1월 27일(토) 조간부터 취급하여
주십시오. 단, 통신/방송/인터넷 매체는 1월
26일(금) 12:00 이후부터 취급 가능

제 목 : 2023년중 외국환은행의 외환거래 동향

- 2023년중 외국환은행의 일평균 외환거래*(현물환 및 외환파생상품 거래) 규모는 659.6억달러로 전년(623.8억달러) 대비 35.7억달러 (+5.7%) 증가

* 일평균 매입 및 매도거래 규모의 합계

- 현물환(258.1억달러, +26.7억달러) 및 외환파생상품(401.5억달러, +9.0억달러) 거래 규모가 모두 증가

“자세한 내용은 ‘붙임’ 참조”

문의처 : 국제국 자본이동분석팀 과장 안주은, 팀장 유재현

<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)

2023년중 외국환은행의 외환거래 동향

□ 2023년중 외국환은행의 일평균 외환거래(현물환 및 외환파생상품 거래) 규모는 659.6억달러*로 전년(623.8억달러) 대비 35.7억달러(+5.7%) 증가

* 2008년 통계 개편 이후 최대치(연중 기준)

○ 수출입 규모 감소에도 불구하고 거주자 및 외국인의 증권투자 매매가 증가한 영향 등으로 증가

	2022년	2023년	(23.상)	(23.하)
■ 수출입 규모 ¹⁾ (억달러)	14,150	12,750	6,403	6,347
■ 국내 투자자의 외화증권 결제액 ²⁾ (억달러)	3,755	3,826	1,887	1,940
■ 외국인 국내증권투자 매수·매도액 ³⁾ (조원, 월평균)	183	209	200	218
■ 환율 변동성 ⁴⁾ (% , 기간중 일평균)	0.50	0.47	0.48	0.46

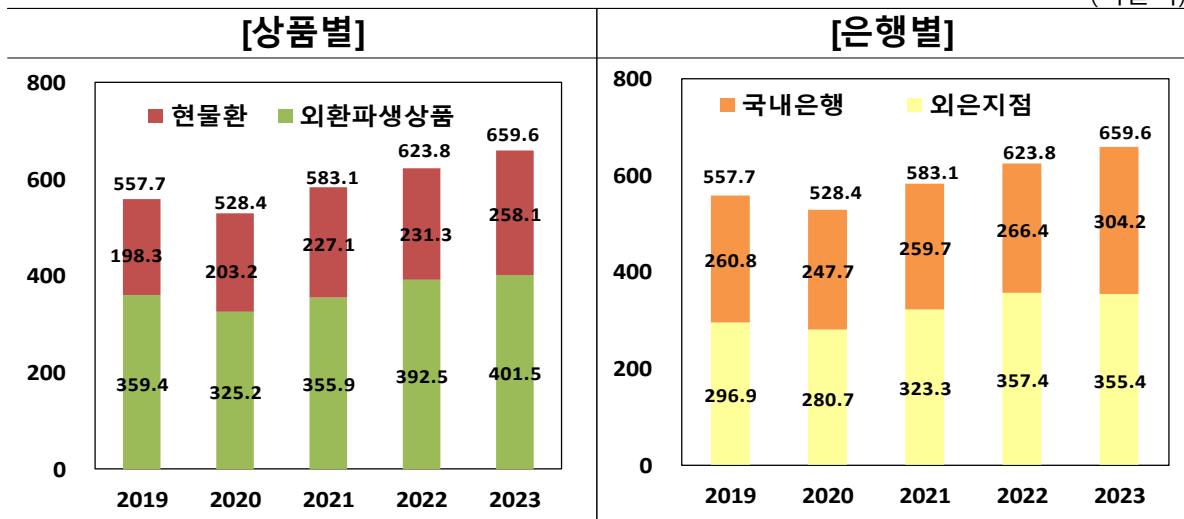
주: 1) 수출금액+수입금액(관세청 수출입 통계) 2) 한국예탁결제원(SEIBro)
3) 상장주식·채권 기준. 23년은 1~11월중(금융감독원) 4) 원/달러 환율 전일대비 변동률

— 상품별로는 현물환 거래규모가 258.1억달러로 전년 대비 26.7억달러(+11.6%) 증가하였으며, 외환파생상품 거래규모는 401.5억달러로 전년 대비 9.0억달러(+2.3%) 증가

— 은행별로는 국내은행의 거래규모가 304.2억달러로 전년 대비 37.8억달러(+14.2%) 증가하였으며, 외은지점의 거래규모는 355.4억달러로 전년 대비 2.1억달러(-0.6%) 감소

외국환은행의 외환거래규모¹⁾

(억달러)



주: 1) 분기중 일평균 총거래규모(매입+매도)

□ (현물환) 2023년중 현물환 거래규모(일평균)는 258.1억달러로 전년 대비 26.7억달러(+11.6%) 증가

- 통화별로는 원/달러 거래(185.1억달러)가 11.9억달러(+6.9%) 증가
- 은행별로는 국내은행의 거래(147.1억달러)가 24.4억달러(+19.9%), 외
은지점의 거래(111.0억달러)는 2.3억달러(+2.1%) 증가
- 거래상대방별로는 외국환은행의 상호거래(134.2억달러)가 31.6억달러
(+30.9%) 증가한 반면 외국환은행의 국내고객(72.4억달러) 및 비거주자
(51.5억달러)와의 거래는 각각 4.1억달러(-5.3%), 0.9억달러(-1.6%) 감소

외국환은행의 현물환¹⁾ 거래규모

(일평균, 억달러, %)

		2020	2021	2022 (A)	2023 (B)	1/4	2/4	3/4	4/4	B-A (증감률)
전 체		203.2	227.1	231.3	258.1	264.5	284.7	241.3	242.0	26.7 (+11.6)
통 화 별	KRW/USD	147.2	170.6	173.2	185.1	189.0	199.0	180.0	172.5	11.9 (+6.9)
	KRW/기타통화	29.5	27.6	25.0	40.9	38.4	50.3	33.0	41.9	15.9 (+63.7)
	KRW/CNY ²⁾	22.9	20.0	18.2	34.6	32.3	43.6	27.1	35.6	16.4 (+89.7)
	JPY/USD	5.3	4.4	6.3	5.8	6.1	6.6	5.5	5.2	-0.5 (-7.4)
	USD/EUR	10.0	11.6	13.4	12.1	15.2	12.3	10.1	10.7	-1.3 (-9.8)
	기타	11.1	12.9	13.5	14.2	15.8	16.5	12.7	11.7	0.7 (+5.1)
银 行 별	국내은행	113.6	121.2	122.7	147.1	142.9	157.8	141.1	146.7	24.4 (+19.9)
	외은지점	89.6	105.9	108.7	111.0	121.5	126.9	100.1	95.4	2.3 (+2.1)
거 래 상 대 방 별	외국환은행간 ³⁾	92.5	100.5	102.5	134.2	134.0	152.1	124.1	126.7	31.6 (+30.9)
	국내고객 ⁴⁾	61.6	70.2	76.5	72.4	76.1	77.2	69.0	67.5	-4.1 (-5.3)
	비거주자 ⁵⁾	49.1	56.4	52.3	51.5	54.4	55.4	48.2	47.9	-0.9 (-1.6)

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) 2023년중 외환파생상품 거래규모(일평균)는 401.5억 달러로 전년 대비 9.0억달러(+2.3%) 증가

- 선물환 거래(126.0억달러)는 NDF거래(+7.9억달러)를 중심으로 전년 대비 5.9억달러(+5.0%) 증가
- 외환스왑 거래(263.0억달러)는 외국환은행의 비거주자(+10.4억달러)와의 거래를 중심으로 전년 대비 4.6억달러(+1.8%) 증가

외국환은행의 외환파생상품 거래규모

(일평균, 억달러, %)

		2020	2021	2022 (A)	2023 (B)	1/4	2/4	3/4	4/4	B-A (증감률)	
전 체		325.2	355.9	392.5	401.5	403.9	409.0	401.9	391.1	9.0	(+2.3)
상 품 별	선 물 환 ¹⁾	99.2	112.3	120.0	126.0	133.7	126.0	126.2	117.8	5.9	(+5.0)
	NDF	79.8	88.1	91.7	99.6	103.4	99.0	102.0	93.9	7.9	(+8.6)
	외환스왑 ²⁾	213.4	229.3	258.3	263.0	256.3	269.6	263.6	262.5	4.6	(+1.8)
	통화스왑 ³⁾	10.4	12.1	12.4	11.5	12.3	12.1	11.2	10.2	-0.9	(-7.6)
	통화옵션 ⁴⁾	2.3	2.1	1.8	1.1	1.5	1.2	0.9	0.6	-0.7	(-38.4)
통 화 별	KRW/USD	268.7	288.0	319.2	318.3	323.8	324.8	315.8	308.4	-1.0	(-0.3)
	KRW/기타통화	7.4	7.5	8.0	9.3	10.7	9.3	8.8	8.5	1.3	(+16.2)
	KRW/CNY ⁵⁾	0.3	0.3	0.8	1.2	1.3	1.1	1.1	1.2	0.4	(+46.7)
	JPY/USD	7.4	8.4	10.7	15.5	11.5	13.0	17.8	19.7	4.8	(+45.1)
	USD/EUR	19.9	27.3	26.9	26.8	25.6	29.9	27.2	24.5	-0.1	(-0.3)
	기타	21.7	24.7	27.7	31.6	32.1	32.0	32.2	30.0	3.9	(+14.1)
금 행 별	국내은행	134.1	138.5	143.7	157.1	147.7	157.9	164.1	158.7	13.4	(+9.3)
	외은지점	191.1	217.4	248.8	244.4	256.1	251.1	237.8	232.4	-4.4	(-1.8)
거 대 상 대 방 별	외국환은행간	130.0	131.6	147.3	140.4	140.0	147.9	138.0	135.9	-6.8	(-4.6)
	국내고객	67.8	75.2	88.0	87.6	90.6	86.9	85.8	87.1	-0.4	(-0.4)
	비거주자	127.4	149.1	157.3	173.5	173.2	174.2	178.2	168.1	16.2	(+10.3)

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, %)

	2020	2021	2022 (A)	2023 (B)					B-A (증감률)
					1/4	2/4	3/4	4/4	
국 내 은 행	247.7	259.7	266.4	304.2	290.7	315.7	305.2	305.4	37.8 (+14.2)
현 물 환	113.6	121.2	122.7	147.1	142.9	157.8	141.1	146.7	24.4 (+19.9)
외환파생	134.1	138.5	143.7	157.1	147.7	157.9	164.1	158.7	13.4 (+9.3)
외 은 지 점	280.7	323.3	357.4	355.4	377.7	377.9	338.0	327.8	-2.1 (-0.6)
현 물 환	89.6	105.9	108.7	111.0	121.5	126.9	100.1	95.4	2.3 (+2.1)
외환파생	191.1	217.4	248.8	244.4	256.1	251.1	237.8	232.4	-4.4 (-1.8)
합 계	528.4	583.1	623.8	659.6	668.3	693.7	643.2	633.1	35.7 (+5.7)

□ 거래상대방별 외환거래규모

(일평균, 억달러, %)

	2020	2021	2022 (A)	2023 (B)					B-A (증감률)
					1/4	2/4	3/4	4/4	
외국환은행간¹⁾	222.5	232.1	249.8	274.6	274.0	300.0	262.0	262.6	24.8 (+9.9)
현 물 환	92.5	100.5	102.5	134.2	134.0	152.1	124.1	126.7	31.6 (+30.9)
선 물 환	13.1	12.2	12.1	15.9	16.4	18.2	15.1	14.0	3.8 (+31.5)
외환스왑	112.2	113.5	129.1	119.2	118.2	124.3	117.7	116.5	-10.0 (-7.7)
통화스왑	4.6	5.8	6.0	5.3	5.4	5.4	5.1	5.3	-0.7 (-11.3)
통화옵션	0.1	0.1	0.1	0.0	0.1	0.0	0.0	0.0	0.0 (-41.6)
국 내 고 객²⁾	129.4	145.4	164.4	160.0	166.8	164.0	154.7	154.6	-4.4 (-2.7)
현 물 환	61.6	70.2	76.5	72.4	76.1	77.2	69.0	67.5	-4.1 (-5.3)
선 물 환	14.6	19.1	22.9	19.1	22.5	17.7	18.3	17.7	-3.8 (-16.6)
외환스왑	48.4	51.6	60.8	65.0	63.7	65.5	63.8	67.0	4.2 (+6.9)
통화스왑	3.6	3.5	3.3	2.9	3.5	2.9	3.1	1.9	-0.4 (-12.0)
통화옵션	1.2	1.1	1.0	0.6	0.9	0.7	0.5	0.4	-0.3 (-34.5)
비 거 주 자³⁾	176.5	205.6	209.6	224.9	227.6	229.6	226.4	216.0	15.3 (+7.3)
현 물 환	49.1	56.4	52.3	51.5	54.4	55.4	48.2	47.9	-0.9 (-1.6)
선 물 환	71.5	81.1	85.0	90.9	94.8	90.1	92.8	86.0	5.9 (+7.0)
외환스왑	52.8	64.2	68.4	78.8	74.4	79.9	82.1	79.0	10.4 (+15.2)
통화스왑	2.2	2.9	3.2	3.3	3.4	3.8	3.0	3.0	0.1 (+4.0)
통화옵션	0.9	1.0	0.7	0.4	0.6	0.5	0.4	0.2	-0.3 (-43.3)
합 계	528.4	583.1	623.8	659.6	668.3	693.7	643.2	633.1	35.7 (+5.7)

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