

외환당국, 국민연금과의 외환스왑 거래 한도를 500억달러로 증액에 합의

외환당국(한국은행, 기획재정부)은 국민연금공단(이하 ‘국민연금’)과 2024년말까지 외환스왑(FX Swap) 거래* 한도를 기존 350억달러에서 500억달러로 증액하기로 합의하였다.

* 자세한 외환스왑 거래 내용 및 구조는 (별첨) 참고

이는 두 기관(외환당국, 국민연금)이 외환스왑 거래를 통해 외환시장의 변동성 확대에 효과적으로 대응한 경험과 국민연금의 해외투자가 지속되는 점 등을 고려하여 두 기관의 대응 여력을 강화하기 위한 조치다.

외환당국은 국민연금과의 외환스왑이 외환시장 불안정시 국민연금의 현물환 매입 수요를 외환스왑으로 흡수할 수 있어 외환시장수급 불균형을 완화시키는 데에 기여할 수 있을 것으로 판단하고 있다.

국민연금도 해외투자에 수반되는 환율 변동 리스크를 완화하고 외화자금 관리의 효율화를 꾀할 수 있다.

스왑거래 기간중 외환보유액이 거래금액 만큼 줄어들지만, 만기시 자금이 전액 환원되기 때문에 외환보유액 감소는 일시적이다.

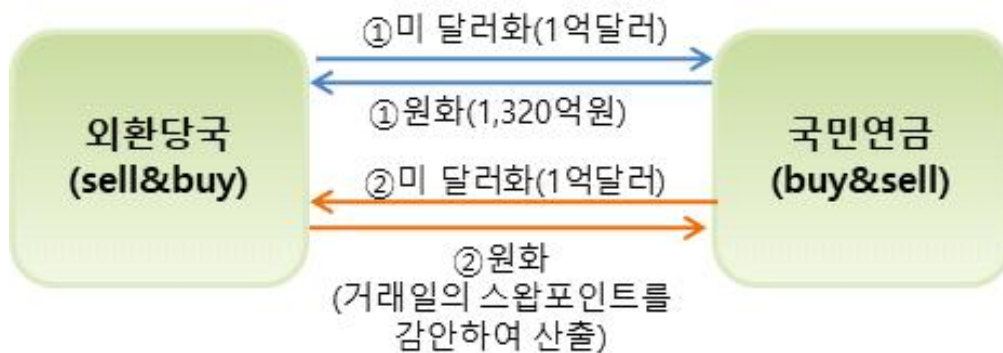
기획재정부	국제금융국 외화자금과	책임자	과 장	김희재 (044-215-4730)
		담당자	사무관	이태운 (lty703@korea.kr)
한국은행	국제국 국제총괄팀	책임자	팀 장	남선우 (02-759-5737)
		담당자	과 장	고지성 (jisung.ko@bok.or.kr)

별 첨

외환당국과 국민연금간 외환스왑 거래 내용

- (거래 형태) 외환스왑(FX Swap) 거래(현재와 동일)
- (만기) 건별 만기는 6개월 또는 12개월(현재와 동일)
- (거래 기한 및 한도) 24.12.31일까지 500억달러 한도 내에서 실시
- (조기청산 권한) 양측 모두 미보유(현재와 동일)

외환당국과 국민연금간 외환스왑 거래 구조(예시)



- ① 외환당국과 국민연금, 12개월 만기로 1억달러 규모의 외환스왑 거래를 실시
 - 외환당국, 국민연금에 1억달러 지급
 - 국민연금, 거래일의 매매기준율(예: 1,320원)을 적용한 원화(1,320억원)를 외환당국에 지급
- ② 만기일에
 - 국민연금, 외환당국에 1억달러 지급
 - 외환당국, 거래일의 스왑포인트를 감안하여 산출한 원화를 국민연금에 지급