

외환당국, 국민연금과의 2024년말까지 350억 달러 한도내에서 외환 교환(스왑) 거래를 실시하기로 재합의

외환당국(기획재정부, 한국은행)은 국민연금공단(이하 ‘국민연금’)과 2024년말까지 350억 달러 한도 내에서 외환스왑(FX Swap) 거래를 실시하기로 합의하였다.

이는 지난 4월에 체결한 350억 달러 한도*의 외환스왑거래를 내년에도 1년간 연장하는데 재합의한 것이며, 필요할 경우 기관간 협의하여 추가적인 한도 확대를 검토할 예정이다.

* 2022년 100억달러, 2023년 350억달러 한도로 외환스왑거래 실시 합의

외환당국은 최근 외환수급이 크게 개선되었지만 환율 변동성이 확대될 위험성도 상존하고 있어 유사시에 대비한 시장안정화 장치를 유지할 필요가 있다고 판단하였다.

또한 국민연금도 해외투자에 수반되는 환율 변동 위험(리스크)을 완화하고, 외화자금 관리의 효율화를 꾀할 수 있을 것으로 기대된다.

한편, 동 거래에 따라 외환보유액이 계약기간 중 일부 감소할 수 있지만, 만기시 자금이 전액 환원되기 때문에 외환보유액 감소는 일시에 그칠 예정이다.

※ 별첨. 외환당국과 국민연금간 외환스왑 거래 내용

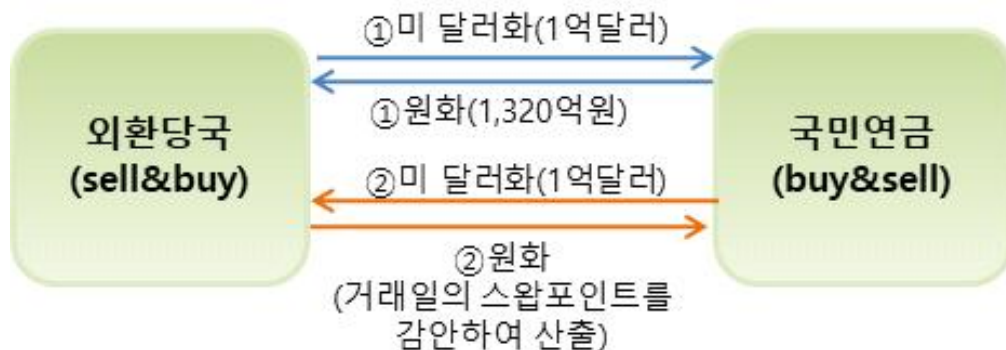
<기획재정부>	국제 금융국 외화자금과	책임자	과 장	유창연 (044-215-4730)
		담당자	사무관	이태윤 (lty703@korea.kr)
		담당자	사무관	이동훈 (ldh5758@korea.kr)
<한국은행>	국제국 국제총괄팀	책임자	팀 장	양양현 (02-759-5737)
		담당자	차 장	권용오 (yokown@bok.or.kr)

별 첨

외환당국과 국민연금간 외환스왑 거래 내용

- (거래 형태) 외환스왑(FX Swap) 거래(2023년과 동일)
- (만기) 건별 만기는 6개월 또는 12개월(2023년과 동일)
- (거래 기한 및 한도) 2024년말까지 350억달러 한도 내에서 실시
- (조기청산 권한) 양측 모두 미보유(2023년과 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