

Weekly Global FX Market Monitor

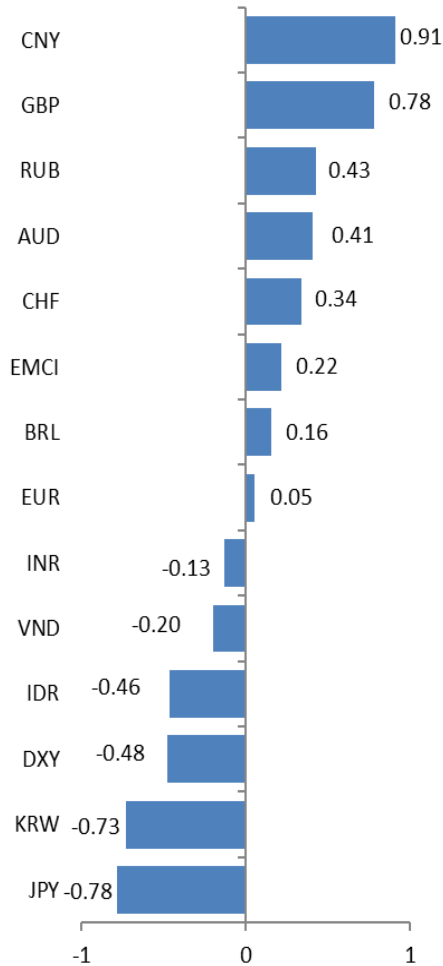
2023.11.27



Global

신한인도네시아은행 자금부 이상훈
021-2975-1716
sanghoonlee@shinhan.com

■ 주간변동률(%)



주 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(11/20~11/24) 글로벌 외환시장은 달러 약세(-0.48%), 유로 강보합(+0.05%), 엔화 약세(-0.78%)
 - 제약적 금리 수준 유지 필요성 강조한 FOMC 회의록, 기대 인플레이션 상승에 달러 인덱스 하락 저지되었으나 미 연준 금리 인상 중단 기대감 이어지며 달러 인덱스는 103.4 마감
 - 미 달러 매수 공백과 중국 정부의 부동산 업체 지원 소식에 유로화는 주초 1.10 달러에 접근했으나 달러화 저가 매수세 유입과 유로존 11월 PMI 결과 확인 후 소폭 하락
 - 미국채 금리 하락에 주중 엔화 환율은 달러당 147엔 초반까지 하락했으나 BOJ에 대한 실망감에 엔화 약세 심리 회복되지 못해 달러당 149엔 달러 마감
- 미 연준의 피벗 기대감에 미 달러 약세 이어지고 있으며 이에 전주 신흥국 통화는 강제 보임
 - 브라질 헤알(0.16%)은 전주 강제 보임. 선거 유세 과정에서 브라질 룰라 대통령에 원색적 비난 이어온 하비에르 밀레이 아르헨티나 대통령 당선인, 룰라 대통령을 자신의 취임식에 초청하며 태도 변화
 - 전주 인도 루피(-0.13%), 베트남 동(-0.20%), 인도네시아 루피아(-0.46%) 모두 약세 기록

미국 국채 금리와 달러 지수 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

유로화와 엔화 환율 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

Weekly Global FX Market Monitor

2023.11.27



Indonesia

신한인도네시아은행 자금부 이상훈
021-2975-1716
sanghoonlee@shinhan.com

환율(USD/IDR)	15,565
52주최고	15,962
52주최저	14,575
주가(Jakarta index)	7,010
52주최고	7,090
52주최저	6,543
국채금리(10년물,%)	6.66
52주최고	7.26
52주최저	6.16
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	4.94
소비자물가(% YoY)	2.56
생산자물가(% YoY)	3.56
정책금리(%)	6.00
제조업 PMI (index)	51.5
산업생산(% YoY)	-1.26
소매판매(% YoY)	1.78
수출(% YoY)	-10.43
수입(% YoY)	-2.42
경상수지(백만달러)	-900
재정수지(십억루피아)	-460,420
외환보유고(십억달러)	133

- 지난 주(11/20~11/24) USD/IDR(market rate)는 15,440~15,575흐름(블룸버그 증가), 전주 대비 약세(-0.46%)
- 2%대 물가상승률 달성까지 제약적 금리 수준 유지할 필요가 있음을 강조한 FOMC 회의록 확인 후 루피 환율 큰 폭 상승. 시장의 미 연준 피벗 기대 지속되고 있음에도 불구하고 지난 주 루피아는 약세 마감
- 루피아 환율 현재 비교적 안정된 흐름 보이고 있어 인도네시아 중앙은행은 11월 통화정책회의에서 기준금리 동결
- 3분기 경상수지는 9억 달러 적자 기록. 2분기 수정치(22.07억 달러 적자) 하회하며 적자폭 축소. 경상수지 적자폭 확대를 우려한 정부가 정부지출을 줄이면서 3분기 경상수지 적자 시장 예상(18.22억 달러) 크게 하회
- 외국인인 지난 주 5영업일 간(11/20~11/24) 인도네시아 주식시장과 채권시장에서 순매수 기록
 - 주식: 외국인 순매수(11/20~11/24 누적: 8,009만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 상승(+0.46%)
 - 채권: 외국인 순매수(11/20~11/23 누적: 4억 1,988만 달러) 기록, 금리 하락(10y, 6.66%, -29.20bp)
- 미 연준의 금리 인상 사이클 종료 기대감 이어지며 루피아 환율 하락에 무게. 금주 11월 소비자물가상승률(시장컨센서스 yoy 2.70%) 발표 예정이며 식료품 가격 상승에 전월(2.56%)보다 소폭 상승할 듯 (금주 예상 레인지 : 15,300~15,800)

인도네시아 루피아 환율과 달러지수 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

인도네시아 주가지수와 국채 금리추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2023.11.27

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2023-11-27	103.42	-0.48	-2.94	-0.63	-0.75	-2.40	-0.10
	유로(EUR/USD)	2023-11-27	1.09	0.05	3.61	1.17	2.22	5.86	2.25
	엔화(USD/JPY)	2023-11-27	149.56	-0.78	0.07	-2.02	-6.09	-7.09	-12.33
	파운드(GBP/USD)	2023-11-27	1.26	0.78	3.97	0.01	2.01	5.39	4.30
	스위스프랑(USD/CHF)	2023-11-27	0.88	0.34	2.30	0.20	2.53	7.61	4.82
	호주 달러(AUD/USD)	2023-11-27	0.66	0.41	3.93	2.41	0.69	-0.99	-3.36
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2023-11-24	1,306.30	-0.73	2.82	1.23	0.86	1.69	-3.12
	중국 위안(USD/CNY)	2023-11-25	7.15	0.91	2.27	1.83	-1.23	0.04	-3.50
	인도 루피(USD/INR)	2023-11-24	83.38	-0.13	-0.22	-0.96	-0.85	-2.10	-0.77
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2023-11-24	15,565.00	-0.46	1.83	-2.06	-4.24	0.64	0.02
	베트남 동(USD/VND)	2023-11-27	24,261.00	-0.20	1.28	-1.07	-3.25	2.22	-2.59
	브라질 헤알(USD/BRL)	2023-11-25	4.90	0.16	1.84	-0.38	1.19	8.37	7.72
	러시아 루블(USD/RUB)	2023-11-25	89.12	0.43	5.04	6.01	-9.74	-32.08	-16.76
Stock - DM	미국 Dow Jones	2023-11-25	35,390.15	1.27	9.17	3.04	6.94	3.04	6.77
	미국 NASDAQ	2023-11-25	14,250.85	0.97	12.72	4.86	9.83	26.94	36.16
	미국 S&P 500	2023-11-25	4,559.34	1.13	10.73	3.49	8.42	13.24	18.75
	일본 NIKKEI225	2023-11-24	33,625.53	0.60	8.50	6.33	8.76	18.89	28.86
	영국 FTSE	2023-11-25	7,488.20	-0.21	2.70	2.04	-1.82	0.02	0.49
	프랑스CAC40	2023-11-25	7,292.80	0.81	7.32	0.87	-0.36	8.65	12.65
	독일 DAX	2023-11-25	16,029.49	0.69	9.14	2.54	0.28	10.23	15.12
Stock - EM	한국 KOSPI	2023-11-24	2,496.63	1.08	8.42	-0.89	-2.43	2.41	11.64
	중국 상해종합	2023-11-24	3,040.97	-0.44	0.77	-0.75	-5.34	-1.96	-1.56
	인도 Sensex	2023-11-24	65,970.04	0.27	3.43	1.67	5.55	5.90	8.43
	인도네시아 Jakarta	2023-11-24	7,009.63	0.46	3.71	1.66	4.82	-0.62	2.32
	베트남 VN index	2023-11-24	1,095.61	-0.51	3.30	-7.42	2.99	12.78	8.79
	러시아 RTS	2023-11-25	1,143.15	1.88	5.94	9.51	8.29	0.18	17.78
브라질 Bovespa	2023-11-25	125,517.27	0.60	10.78	8.36	13.17	15.18	14.38	
Rates - DM	미국(10y)	2023-11-24	4.47	3.11	-35.64	22.93	72.46	77.38	59.17
	독일(10y)	2023-11-24	2.64	5.50	-18.50	13.00	17.10	79.30	7.20
	영국(10y)	2023-11-24	4.28	17.90	-25.60	-14.30	6.90	124.50	61.10
	일본(10y)	2023-11-24	0.78	2.10	-7.40	12.10	36.30	52.90	35.50
Rates - EM	한국(10y)	2023-11-24	3.78	-3.00	-48.50	-10.20	26.80	16.00	4.00
	인도(10y)	2023-11-24	7.27	5.40	-10.90	7.30	27.90	1.30	-5.80
	인도네시아(10y)	2023-11-24	6.66	-29.20	-60.00	13.20	23.60	-31.80	-28.00
	베트남(10y)	2023-11-24	2.65	-20.00	-65.00	-15.00	-55.00	-255.00	-230.00
	러시아(10y)	2023-11-20	11.78	-17.30	-54.10	54.81	91.75	294.20	147.48
브라질(10y)	2023-11-24	11.12	6.70	-60.20	4.70	-53.40	-241.50	-157.30	
Commodity	WTI	2023-11-27	75.45	-0.58	-11.80	-5.49	3.83	-1.09	-5.99
	브렌트유	2023-11-27	80.54	-2.16	-10.99	-4.66	4.67	-3.69	-6.25
	금	2023-11-27	2,002.13	1.22	-0.21	4.27	3.03	14.98	9.76

자료: Bloomberg, Datastream, 신한은행 S&T센터

주1) FX부문 기간별 변동률은 달러 대비 절상(+) 또는 절하(-)를 의미

주2) 금리 부문은 각 국가의 10년물 국채금리(%)를 의미하며, 기간별 변동률 단위는 bp(=0.01%)로 표현