

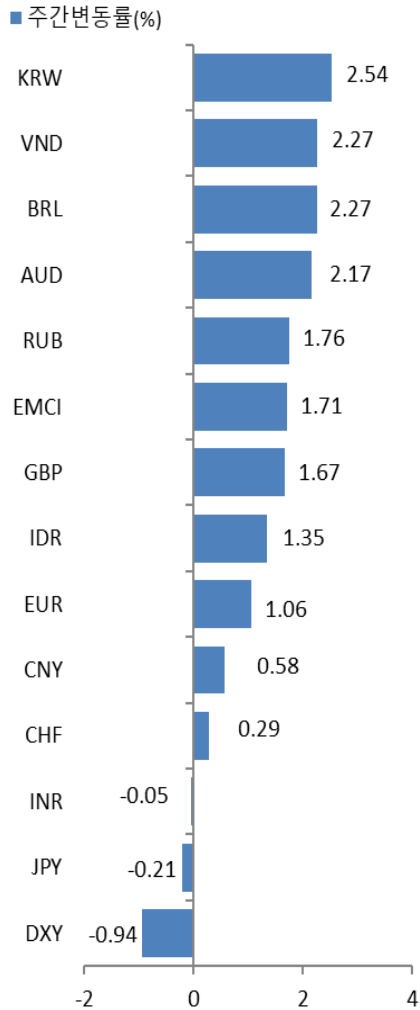
Weekly Global FX Market Monitor

2023.11.06



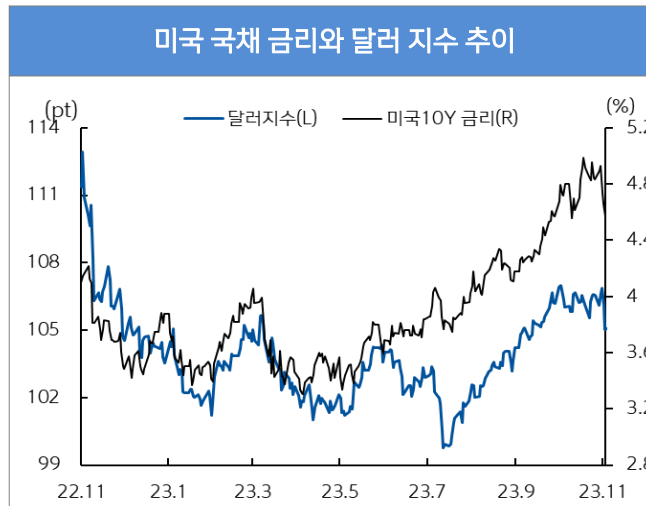
Global

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

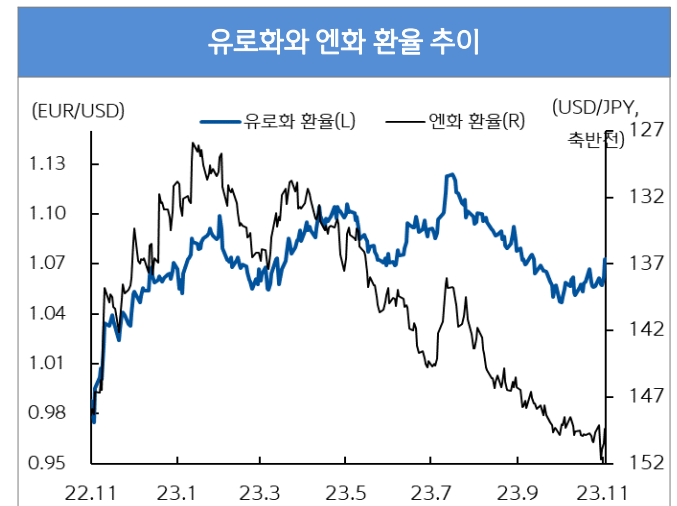


주 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(10/30~11/03) 글로벌 외환시장은 달러 약세(-0.94%), 유로 강세(+1.06%), 엔화 약세(-0.21%)
 - 10월 비농업고용은 전월대비 15만명 증가하며 예상치(17만명)과 전월(29.7만명) 크게 하회. 10월 FOMC의 금리 동결에 이어 고용 둔화 확인 후 시장은 금리 인상 사이클 종료 기대 키웠고 미달러 인덱스는 하락
 - 유로화는 달러 약세에 전주 강세보였고 1.07달러 마감. 유로존 소비자물가상승률 둔화세 보이며 2년여만의 최저치(2.9%) 기록. 3분기 경제성장률 -0.1%로 역성장 기록
 - 10월 회의에서 일본중앙은행(BOJ) 장기금리 1% 상한 초과를 허용하였으나 정책 수정 시장 기대에 못미쳐 엔화는 한때 달러당 152엔에 근접. FOMC 후 달러 약세에도 불구하고 엔화 환율 하락폭 제한
- 10월 FOMC 회의 결과 확인 후 미국채 금리와 미 달러 인덱스 하락했으며 이에 신흥국 통화는 전주 강세
 - 예산 적자 증가에 대한 우려에도 불구하고 올해 무역수지 흑자 크게 증가하자 브라질 헤알(+2.27%)은 강세 보임. 미 연준의 금리 동결로 인한 시장 투자심리 개선도 헤알 환율 하락에 기여
 - 인도 루피(-0.05%)는 약보합 기록했으나 베트남 동(+2.27%)과 인도네시아 루피아(+1.35%)는 강세 기록



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

Weekly Global FX Market Monitor

2023.11.06



Indonesia

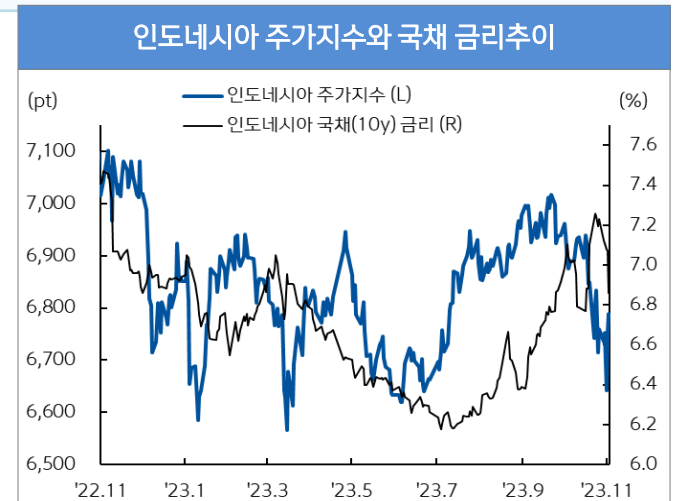
신한인도네시아은행 자금부 이상훈
021-2975-1716
sanghoonlee@shinhan.com

환율(USD/IDR)	15,728
52주최고	15,962
52주최저	14,575
주가(Jakarta index)	6,789
52주최고	7,111
52주최저	6,543
국채금리(10년물,%)	6.86
52주최고	7.48
52주최저	6.16
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	5.17
소비자물가(% YoY)	2.56
생산자물가(% YoY)	3.28
정책금리(%)	6.00
제조업 PMI (index)	51.5
산업생산(% YoY)	-1.26
소매판매(% YoY)	1.00
수출(% YoY)	-16.17
수입(% YoY)	-12.45
경상수지(백만달러)	-1,900
재정수지(십억루피아)	-460,420
외환보유고(십억달러)	135

- 지난 주(10/30~11/03) USD/IDR(market rate)는 15,728~15,935흐름(블룸버그 종가), 전주 대비 강세(+1.35%)
- 하락 출발한 루피아 환율은 확장국면을 유지하고 있는 10월 제조업 PMI(51.5)와 시장 예상치(2.6%)를 하회하는 10월 소비자물가상승률(2.56%)에도 불구하고 주중 상승세 보였음. 그러나 10월 미 연준의 금리 동결 후, 미 금리 인상 종료 기대에 루피아 강세 전환. 채권시장 글로벌 자금 유입도 루피아 강세에 일조
- 외국인 은 지난 주 5영업일 간(10/30~11/3) 인도네시아 주식시장에서 순매도 채권시장에서 순매수 기록
 - 주식: 외국인 순매도(10/30~11/3 누적: 1억 5,866만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 상승(+0.44%)
 - 채권: 외국인 순매수(10/30~11/2 누적: 4억 1,988만 달러) 기록, 금리 하락(10y, 6.86%, -37.30bp)
- 10월 미 FOMC 이후 금리 인상 종료 기대감 커진 상태에서 10월 미국 고용 둔화 확인하며 연준의 금리 인상 사이클 마무리 단계에 접어들었다는 시장 전망 확산. 연준 의원들의 매파적 발언 예상되나 시장은 금리 인상 종료 기대감 키울 것으로 보이며 위험자산 투자심리도 개선될 듯. 이에 금주 루피아 강세에 무게 (금주 예상 레인지 : 15,560~16,100)



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2023.11.06

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2023-11-06	105.12	-0.94	-0.87	3.04	3.86	-5.19	1.55
	유로(EUR/USD)	2023-11-06	1.07	1.06	1.33	-2.50	-2.52	7.06	0.21
	엔화(USD/JPY)	2023-11-06	149.42	-0.21	-0.07	-4.63	-9.58	-1.87	-12.25
	파운드(GBP/USD)	2023-11-06	1.24	1.67	1.11	-3.22	-1.94	7.46	2.40
	스위스프랑(USD/CHF)	2023-11-06	0.90	0.29	1.16	-2.96	-1.10	9.92	2.79
	호주 달러(AUD/USD)	2023-11-06	0.65	2.17	1.97	-0.93	-3.98	0.51	-4.42
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2023-11-03	1,322.30	2.54	2.05	-1.75	1.19	7.69	-4.30
	중국 위안(USD/CNY)	2023-11-04	7.28	0.58	0.31	-1.45	-4.99	0.36	-5.18
	인도 루피(USD/INR)	2023-11-03	83.29	-0.05	-0.10	-0.66	-1.75	-0.47	-0.66
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2023-11-03	15,728.00	1.35	-0.94	-3.45	-6.63	-0.20	-1.02
	베트남 동(USD/VND)	2023-11-06	24,564.00	0.01	-0.71	-3.42	-4.54	1.22	-3.79
	브라질 헤알(USD/BRL)	2023-11-04	4.90	2.27	5.39	0.26	1.86	4.35	7.69
러시아 루블(USD/RUB)	2023-11-04	92.69	1.76	7.72	1.58	-15.57	-32.79	-19.97	
Stock - DM	미국 Dow Jones	2023-11-04	34,061.32	5.07	1.96	-2.86	1.15	5.12	2.76
	미국 NASDAQ	2023-11-04	13,478.28	6.61	0.35	-2.98	10.16	28.67	28.78
	미국 S&P 500	2023-11-04	4,358.34	5.85	1.16	-2.67	5.37	15.59	13.51
	일본 NIKKEI225	2023-11-02	31,949.89	4.41	2.28	-0.65	9.58	15.50	22.44
	영국 FTSE	2023-11-04	7,417.73	1.73	-1.03	-1.94	-4.64	1.13	-0.46
	프랑스CAC40	2023-11-04	7,047.50	3.71	-0.18	-3.66	-5.19	9.84	8.86
	독일 DAX	2023-11-04	15,189.25	3.42	-0.27	-4.78	-4.84	12.85	9.09
Stock - EM	한국 KOSPI	2023-11-03	2,368.34	2.85	-1.68	-9.01	-5.30	0.85	5.90
	중국 상해종합	2023-11-03	3,030.80	0.43	-2.56	-7.82	-9.11	-1.30	-1.89
	인도 Sensex	2023-11-03	64,363.78	0.91	-2.47	-2.07	5.42	5.60	5.79
	인도네시아 Jakarta	2023-11-03	6,788.85	0.44	-1.45	-0.93	0.02	-3.64	-0.90
	베트남 VN index	2023-11-03	1,076.78	1.52	-4.59	-12.17	3.51	7.99	6.92
	러시아 RTS	2023-11-03	1,093.74	1.36	10.80	7.68	5.81	-0.05	12.69
브라질 Bovespa	2023-11-04	118,159.97	2.95	3.50	-1.13	12.37	0.00	7.68	
Rates - DM	미국(10y)	2023-11-03	4.57	-26.22	-22.31	39.73	123.68	42.55	69.76
	독일(10y)	2023-11-03	2.65	-18.70	-32.30	4.00	39.80	40.00	7.40
	영국(10y)	2023-11-03	4.29	-25.60	-30.90	-18.20	59.20	76.70	61.60
	일본(10y)	2023-11-03	0.93	4.50	15.90	27.30	50.50	67.20	50.40
Rates - EM	한국(10y)	2023-11-03	4.10	-19.00	8.80	24.00	78.30	-9.00	36.50
	인도(10y)	2023-11-03	7.31	-4.20	8.00	11.70	30.70	-16.70	-1.40
	인도네시아(10y)	2023-11-03	6.86	-37.30	-16.30	55.90	37.70	-57.00	-8.10
	베트남(10y)	2023-11-03	3.01	-9.00	16.00	49.00	-32.00	-218.00	-207.00
	러시아(10y)	2023-11-03	12.03	-21.81	5.57	86.06	111.17	319.03	172.31
	브라질(10y)	2023-11-03	11.45	-25.90	-63.00	58.70	-67.60	-44.90	-123.40
Commodity	WTI	2023-11-06	80.93	-1.68	-2.25	-2.28	13.44	-12.61	0.83
	브렌트유	2023-11-06	85.20	-2.57	0.73	-1.21	13.15	-13.56	-0.83
	금	2023-11-06	1,988.79	-0.37	8.50	2.70	-1.60	18.69	9.03

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