

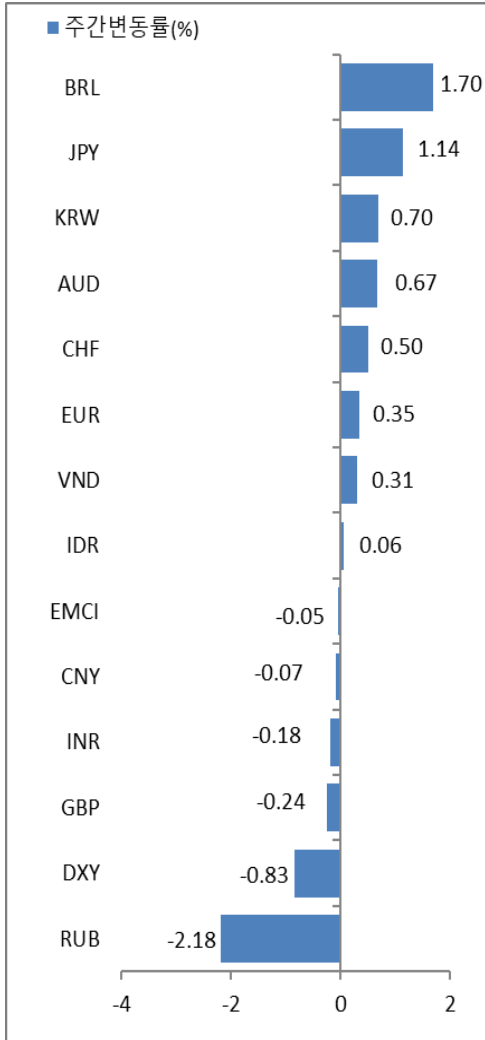
Weekly Global FX Market Monitor

2023.12.27



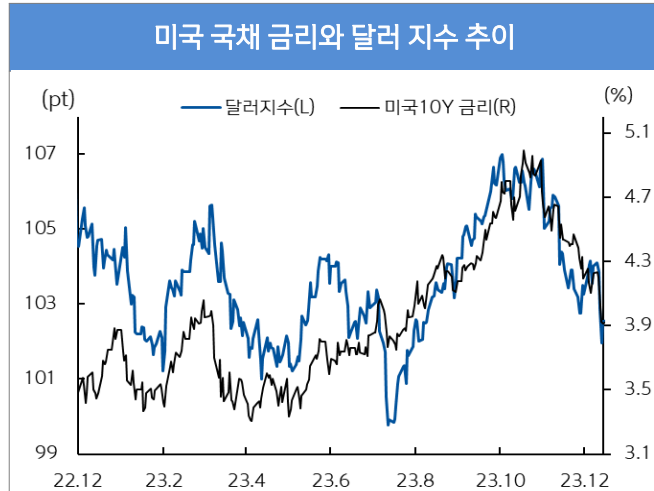
Global

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

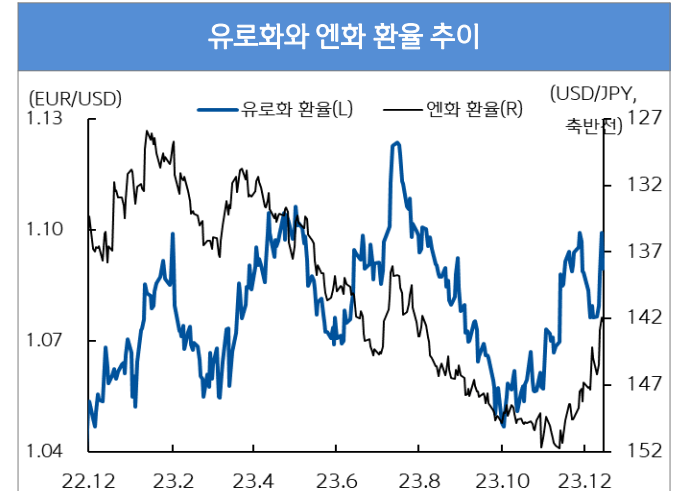


주 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(12/18~12/22) 글로벌 외환시장은 달러 약세(-0.83%), 유로 강세(+0.36%), 엔화 강세(+1.14%)
 - 연준 위원들의 과도한 금리 인하 베팅 경고와 홍해 물류 차질에 달러 인덱스 상승했으나 미 3분기 GDP 확정치와 PCE 물가지수가 시장 예상치 하회하자 시장은 미 연착륙 전망 유지했고 달러 인덱스 101.6pt 마감
 - 독일 Ifo 경기기대지수 부진 등 부정적 이벤트에도 불구하고 유로화 상승
 - 최근 통화정책 정상화 기대에도 불구하고 BOJ(일본중앙은행)가 12월 통화정책회의에서 정책 동결하자 달러엔 환율 상승했으나 미국 금리 하락으로 환율도 다시 하락하며 142엔대 마감
- 미 연준의 조기 금리 인하 기대감 유지되는 가운데 신흥국 통화지수도 안정적 흐름 보이며 소폭 하락
 - 브라질 중앙은행은 '23년과 '24년 인플레이션을 각각 4.6%, 3.5%로 전망. 이는 '23년(3.25%)과 '24년(3%) 목표치를 상회하는 수준. 철광석 등 기타 원자재 가격 상승에 브라질 헤알(+1.70%)은 전주 강세 보임.
 - 전주 인도 루피(-0.18%)는 약세, 베트남 동(+0.31%)은 강세, 인도네시아 루피아(+0.06%)는 강보합 기록



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

Weekly Global FX Market Monitor

2023.12.27



Indonesia

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

환율(USD/IDR)	15,483
52주최고	15,962
52주최저	14,575
주가(Jakarta index)	7,238
52주최고	7,249
52주최저	6,543
국채금리(10년물,%)	6.50
52주최고	7.26
52주최저	6.16
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	4.94
소비자물가(% YoY)	2.86
생산자물가(% YoY)	3.55
정책금리(%)	6.00
제조업 PMI (index)	51.7
산업생산(% YoY)	-1.89
소매판매(% YoY)	2.90
수출(% YoY)	-8.56
수입(% YoY)	3.29
경상수지(백만달러)	-900
재정수지(십억루피아)	-460,420
외환보유고(십억달러)	138

- 지난 주(12/18~12/22) USD/IDR(market rate)는 15,483~15,525흐름(블룸버그 증가), 전주 대비 강보합(+0.06%)
- 연준 위원들이 시장의 금리 인하 기대 과도하다고 잇따라 경고하자 루피아 환율 소폭 상승했으나 인도네시아 중앙은행의 고금리 장기화 기조 확인하며 루피아 환율 하락 전환
- 인도네시아 중앙은행은 12월 통화정책회의에서 금리 동결(기준금리: 6%). 인플레이션의 목표 범위 내 유지와 환율 안정성이 여전히 중앙은행의 주된 관심사임을 강조
- 외국인은 지난 주 5영업일 간(12/18~12/22) 인도네시아 주식시장과 채권시장에서 순매수 기록
 - 주식: 외국인 순매수(12/18~12/22 누적: 9,333만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 상승(+0.65%)
 - 채권: 외국인 순매수(12/18~12/20 누적: 2억 3,617만 달러) 기록, 금리 하락(10y, 6.50%, -7.30bp)
- 11월 미 PCE 데이터 둔화로 미 연준의 연착륙 기대는 금주에도 이어질 것으로 예상. 이에 루피아 환율 소폭 하락 할 것으로 예상되지만 연말 거래량 감소로 환율 변동폭 크지 않을 듯 (금주 예상 레인지 : 15,200~15,650)



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2023.12.27

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2023-12-22	101.70	-0.83	-2.14	-3.68	-0.67	-2.62	-1.76
	유로(EUR/USD)	2023-12-26	1.10	0.36	0.61	4.25	1.05	3.61	2.95
	엔화(USD/JPY)	2023-12-26	142.22	1.14	4.55	4.82	0.91	-6.57	-7.80
	파운드(GBP/USD)	2023-12-26	1.27	-0.20	0.63	4.51	-0.06	5.34	5.16
	스위스프랑(USD/CHF)	2023-12-26	0.86	0.57	2.84	6.99	4.64	8.88	8.00
	호주 달러(AUD/USD)	2023-12-26	0.68	0.67	3.04	6.42	1.99	1.20	-0.07
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2023-12-22	1,302.90	-0.50	-0.18	2.60	-0.62	-2.06	-2.87
	중국 위안(USD/CNY)	2023-12-26	7.14	-0.07	0.23	2.46	1.45	-2.43	-3.33
	인도 루피(USD/INR)	2023-12-22	83.15	-0.18	0.20	-0.26	-1.44	-0.47	-0.50
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2023-12-22	15,483.00	0.06	0.59	-0.70	-3.51	0.65	0.55
	베트남 동(USD/VND)	2023-12-25	24,245.00	0.31	-0.00	0.58	-2.93	-2.59	-2.52
	브라질 헤알(USD/BRL)	2023-12-23	4.86	1.70	0.97	1.56	-1.88	6.42	8.63
러시아 루블(USD/RUB)	2023-12-23	92.32	-2.18	-4.15	3.74	-9.90	-26.12	-19.64	
Stock - DM	미국 Dow Jones	2023-12-23	37,385.97	0.22	5.64	9.94	10.85	12.60	12.79
	미국 NASDAQ	2023-12-23	14,992.97	1.21	5.21	12.97	11.12	42.82	43.25
	미국 S&P 500	2023-12-23	4,754.63	0.75	4.28	9.62	9.34	23.66	23.83
	일본 NIKKEI225	2023-12-25	33,254.03	1.51	-1.10	2.91	1.70	25.93	27.44
	영국 FTSE	2023-12-22	7,697.51	1.60	2.80	0.96	3.16	3.00	3.30
	프랑스CAC40	2023-12-23	7,568.82	-0.37	3.78	6.25	5.66	16.36	16.92
	독일 DAX	2023-12-23	16,706.18	-0.27	4.22	8.44	5.54	19.84	19.98
Stock - EM	한국 KOSPI	2023-12-22	2,599.51	1.40	4.12	4.16	1.14	12.35	16.24
	중국 상해종합	2023-12-25	2,918.81	-0.41	-4.02	-5.91	-7.36	-4.79	-5.52
	인도 Sensex	2023-12-22	71,106.96	-0.53	7.79	7.70	12.91	18.82	16.87
	인도네시아 Jakarta	2023-12-22	7,237.52	0.65	3.25	3.42	9.00	6.42	5.65
	베트남 VN index	2023-12-25	1,117.66	2.36	2.01	-1.78	-1.27	13.44	10.98
	러시아 RTS	2023-12-26	1,063.67	-1.10	-6.95	6.68	2.28	10.40	9.59
브라질 Bovespa	2023-12-23	132,752.93	1.96	5.76	14.52	11.58	21.02	20.98	
Rates - DM	미국(10y)	2023-12-25	3.90	-3.64	-57.15	-63.84	16.03	14.78	2.02
	독일(10y)	2023-12-25	1.98	-10.00	-66.40	-81.90	-37.40	-42.40	-59.20
	영국(10y)	2023-12-25	3.51	-19.00	-77.80	-81.80	-81.50	-13.20	-16.70
	일본(10y)	2023-12-25	0.62	-5.70	-15.40	-11.30	25.40	23.80	20.10
Rates - EM	한국(10y)	2023-12-22	3.29	-5.70	-46.90	-70.40	-36.20	-17.90	-44.40
	인도(10y)	2023-12-22	7.19	2.30	-5.90	-0.10	9.90	-12.60	-14.20
	인도네시아(10y)	2023-12-22	6.50	-7.30	-16.50	-26.70	20.70	-43.80	-44.40
	베트남(10y)	2023-12-25	2.25	-5.00	-20.00	-45.00	-55.00	-300.00	-290.00
	러시아(10y)	2023-12-25	11.87	-10.01	8.78	10.85	81.55	141.33	156.26
브라질(10y)	2023-12-22	10.39	-27.60	-69.50	-104.50	-67.50	-259.30	-229.80	
Commodity	WTI	2023-12-26	73.86	1.92	-2.22	-18.29	6.47	-7.16	-7.97
	브렌트유	2023-12-22	79.07	3.29	-3.53	-15.22	6.65	-2.36	-7.96
	금	2023-12-23	2,053.08	1.66	3.16	6.64	7.27	14.54	12.56

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