

Weekly Global FX Market Monitor

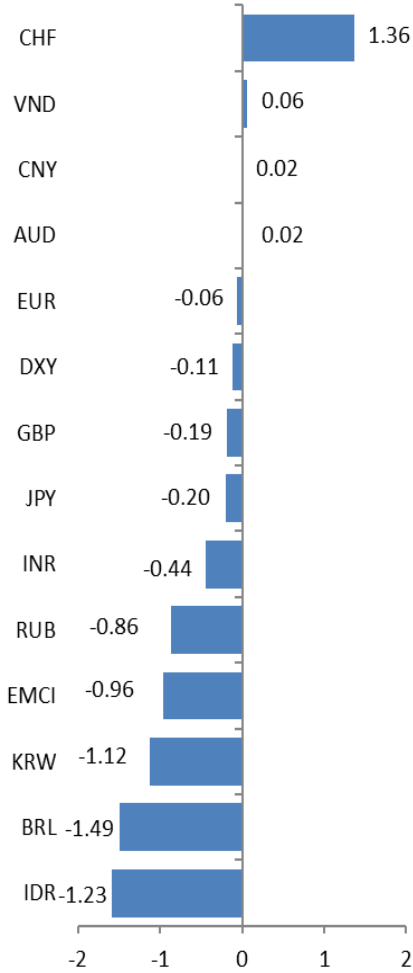
2024.6.3



Global

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

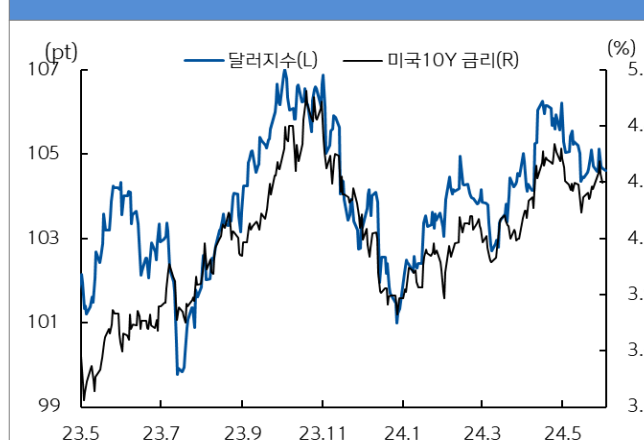
■ 주간변동률(%)



주 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(5/27~5/31) 글로벌 외환시장은 달러 약세(-0.11%), 유로 약세(-0.06%), 엔화 약세(-0.20%)
 - 미국채 입찰부진으로 국채 금리 상승하며 미 달러지수 105pt 선까지 상승했으나 개인소비 부진으로 인해 1분기 GDP 수정치가 하향 조정되었고 4월 PCE 가격지수 예상 부합하자 104pt 선까지 하락
 - 유로화는 주중 한 때 1.09달러 육박했으나 연속적인 미국채 입찰 부진으로 미국채 금리 급등하자 유로화가 하락 전환하며 1.084달러 마감
 - 엔화는 미국채 금리 급등에 달러당 158엔 근처까지 상승했으나 주 후반 미국채 금리 하락하자 엔화 환율도 소폭 하락
- 연이은 미국채 입찰 부진으로 상승한 미국채 금리가 투자심리에 부담으로 작용하며 전주 신흥국 통화 지수 하락
 - 31일 발표된 중국 5월 제조업 PMI는 시장 예상과 달리 50 하회. 여전한 제조업 경기 위축세 확인. 전주 중국 위안(0.02%)은 강보합
 - 전주 인도 루피(-0.44%)와 인도네시아 루피아(-1.23%) 약세 보였으나 베트남 동(+0.08%)은 강세 보임

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

2024. 6. 3



Indonesia

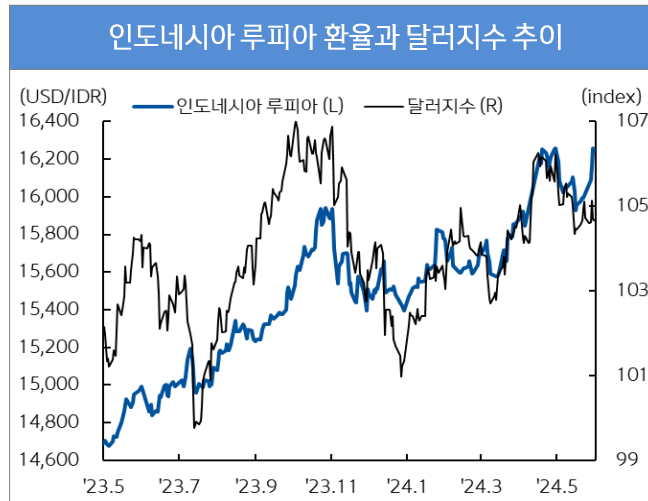
신한인도네시아은행 자금부 이상훈
021-2975-1716
sanghoonlee@shinhan.com

환율(USD/IDR)	16,250
52주최고	16,288
52주최저	14,820
주가(Jakarta index)	6,971
52주최고	7,454
52주최저	6,563
국채금리(10년물,%)	6.92
52주최고	7.26
52주최저	6.16

주요 경제 지표 Snap shot

실질GDP성장률(% YoY)	5.11
소비자물가(% YoY)	3
생산자물가(% YoY)	3.71
정책금리(%)	6.25
제조업 PMI (index)	52.9
산업생산(% YoY)	-1.28
소매판매(% YoY)	0.10
수출(% YoY)	1.72
수입(% YoY)	4.62
경상수지(백만달러)	-2,161
재정수지(십억루피아)	-460,420
외환보유고(십억달러)	136

- 지난 주(5/27~5/31) USD/IDR(market rate)는 16,065~16,260(블룸버그 종가), 전주 대비 약세(-1.23%)
- 예상보다 매파적이었던 FOMC 의사록과 강한 미 PMI 데이터로 인한 달러 강세가 인도네시아 휴일로 인해 외환시장에 뒤늦게 반영되면서 지난 주 초부터 인도네시아 루피아 약세 보였음. 이에 더해 주중 미국채 입찰 부진으로 미 금리 상승하자 위험자산 투자심리에 부담으로 작용하며 루피아 환율 추가 상승
- 외국인은 지난 주 5영업일 간(5/27~5/31) 인도네시아 주식시장에서 순매도, 채권시장에서 순매수 기록
 - 주식: 외국인 순매도(5/27~5/31 누적: 2억 9,784만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 하락(-3.48%)
 - 채권: 외국인 순매수(5/28~5/30 누적: 2억 7,798만 달러) 기록, 금리 하락(10y, 6.92%, -1.20bp)
- 미 4월 PCE 물가는 시장 예상에 부합하며 장기적인 하락 흐름은 유지했으나 연준의 금리 인하를 확신하기에 충분하지 않아 큰 폭의 루피아 환율 하락 기대하기 어려울 듯. 6월 ECB의 금리 인하가 상당부분 시장에 반영되어 있지만 ECB의 결정이 달러화 강세에 영향을 줄 경우 루피아 환율 상승 가능성도 배제할 수 없음 (금주 예상 레인지 : 15,950~16,290)



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.6.3

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-06-03	104.61	-0.11	-0.40	0.72	1.30	0.57	3.23
	유로(EUR/USD)	2024-06-03	1.09	-0.06	0.85	-0.04	0.15	1.30	-1.69
	엔화(USD/JPY)	2024-06-03	157.19	-0.20	-2.63	-4.24	-6.35	-11.20	-10.27
	파운드(GBP/USD)	2024-06-03	1.27	-0.19	1.58	0.42	0.89	2.47	0.11
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-06-03	0.90	1.36	0.44	-1.83	-3.17	0.54	-6.66
	호주 달러(AUD/USD)	2024-06-03	0.67	0.02	0.68	2.23	0.53	0.57	-2.30
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-05-31	1,385.00	-1.12	-0.21	-3.87	-6.85	-4.23	-7.00
	중국 위안(USD/CNY)	2024-06-01	7.24	0.02	-0.01	-0.73	-1.47	-1.84	-1.96
	인도 루피(USD/INR)	2024-05-31	83.47	-0.44	-0.03	-0.66	-0.08	-0.88	-0.31
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-05-31	16,250.00	-1.58	0.06	-3.29	-4.55	-7.74	-5.25
	베트남 동(USD/VND)	2024-06-01	25,450.00	0.08	-0.45	-3.15	-4.67	-7.70	-4.64
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-06-01	5.25	-1.49	-1.00	-5.25	-6.23	-3.63	-7.41
	러시아 루블(USD/RUB)	2024-06-01	90.38	-0.86	3.40	0.91	-0.52	-10.08	-1.01
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-06-01	38,686.32	-0.97	0.03	-1.03	6.73	14.58	2.64
	미국 NASDAQ	2024-06-01	16,735.02	-0.01	3.58	2.83	16.99	26.39	11.48
	미국 S&P 500	2024-06-01	5,277.51	0.18	2.92	2.73	14.86	23.24	10.64
	일본 NIKKEI225	2024-05-31	38,487.90	-0.41	0.66	-3.57	15.12	22.09	15.01
	영국 FTSE	2024-06-01	8,275.38	-0.77	0.75	7.72	9.91	8.78	7.01
	프랑스CAC40	2024-06-01	7,992.87	-1.26	0.44	0.74	8.80	9.93	5.96
	독일 DAX	2024-06-01	18,497.94	-1.05	2.76	4.30	12.81	15.24	10.42
Stock - EM	한국 KOSPI	2024-05-31	2,636.52	-3.18	-1.50	-0.22	5.25	1.35	-0.71
	중국 상해종합	2024-05-31	3,086.81	-0.07	-0.58	1.98	1.82	-4.44	3.76
	인도 Sensex	2024-05-31	73,961.31	-1.92	0.11	0.21	9.60	18.25	2.38
	인도네시아 Jakarta	2024-05-31	6,970.74	-3.48	-2.30	-4.67	-1.26	5.09	-4.15
	베트남 VN index	2024-05-31	1,261.72	-0.02	3.33	0.27	14.48	15.66	11.66
	러시아 RTS	2024-06-01	1,125.68	-5.85	-4.98	0.30	2.78	7.05	3.89
	브라질 Bovespa	2024-06-01	122,098.09	-2.11	-4.99	-5.48	-4.75	8.48	-9.01
Rates - DM	미국(10y)	2024-05-31	4.50	3.35	-18.13	24.83	17.21	85.59	61.94
	독일(10y)	2024-05-31	2.66	8.10	8.00	25.30	21.70	38.20	64.00
	영국(10y)	2024-05-31	4.32	5.70	-2.90	19.40	14.20	13.50	78.10
	일본(10y)	2024-05-31	1.07	6.50	19.10	36.10	39.80	63.40	45.60
Rates - EM	한국(10y)	2024-05-31	3.58	7.30	-7.00	10.00	-11.70	6.00	40.50
	인도(10y)	2024-05-31	6.98	-6.50	-20.50	-9.70	-29.90	-0.70	-19.30
	인도네시아(10y)	2024-05-31	6.92	-1.20	-32.40	31.80	29.40	55.30	44.30
	베트남(10y)	2024-05-31	2.97	-6.00	4.00	59.00	39.00	-31.00	60.00
	러시아(10y)	2024-05-31	14.96	46.31	137.23	265.13	322.03	407.56	309.57
브라질(10y)	2024-05-31	11.89	12.70	3.60	103.30	98.50	32.10	152.30	
Commodity	WTI	2024-06-03	76.63	-1.40	-1.89	-4.18	3.46	6.82	6.95
	브렌트유	2024-06-03	80.70	-2.89	-2.72	-3.41	2.31	6.00	4.75
	금	2024-06-03	2,325.51	-1.08	1.03	9.98	14.59	18.54	12.73

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