

Weekly Global FX Market Monitor

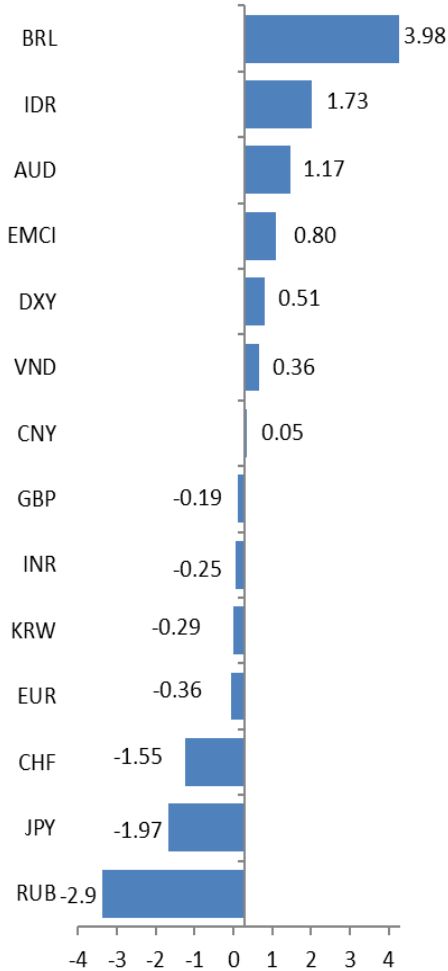
2024.8.12



Global

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

■ 주간변동률(%)



주 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(8/5~8/9) 글로벌 외환시장은 달러 강세(+0.51%), 유로 약세(-0.36%), 엔화 약세(-1.97%)
 - 미 경기 침체 우려와 엔 캐리 트레이드 청산으로 주초 미 달러 인덱스 하락하였으나 시장 위험회피 심리 높아지고 일본 중앙은행의 금리 인상 신증론에 달러 인덱스 반등 마감
 - 엔캐리 트레이드 청산으로 외환시장 변동성 커졌으나 유로화는 1.09 달러에서 하방 경직적인 양상 보이며 변동성 크지 않았음
 - 미 고용 부진과 중앙은행 금리인상으로 엔화 환율은 하락했었으나, 미 고용에 대한 우려 개선 및 연내 추가금리 인상 가능성 감소함에 따라 엔화 환율은 반등했고 달러당 146엔대로 마감
- 미 경기에 대한 우려로 투자심리 악화되면서 신흥국 통화지수(+0.80%)는 주초 하락하였으나 미 경기에 대한 우려 과도했다는 인식 하에 시장 안정되었고 통화지수는 상승 마감
 - 엔 캐리 트레이드 청산 과정에서 저금리 통화 상승세 뚜렷해졌고 이에 위안(+0.05%) 주초 강세보였으나 주 후반 시장 안정되며 환율 소폭 하락
 - 전주 인도(-0.25%) 루피는 약세, 베트남 동(+0.36%)과 인도네시아 루피아(+1.73%)는 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. 8. 12



Indonesia

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

환율(USD/IDR)	15,925
52주최고	16,478
52주최저	15,217
주가(Jakarta index)	7,257
52주최고	7,454
52주최저	6,640
국채금리(10년물,%)	6.77
52주최고	7.26
52주최저	6.32
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	5.05
소비자물가(% YoY)	2.13
생산자물가(% YoY)	2.99
정책금리(%)	6.25
제조업 PMI (index)	49.3
산업생산(% YoY)	-1.28
소매판매(% YoY)	4.43
수출(% YoY)	1.17
수입(% YoY)	7.58
경상수지(백만달러)	-2,161
재정수지(십억루피아)	-460,420
외환보유고(십억달러)	145

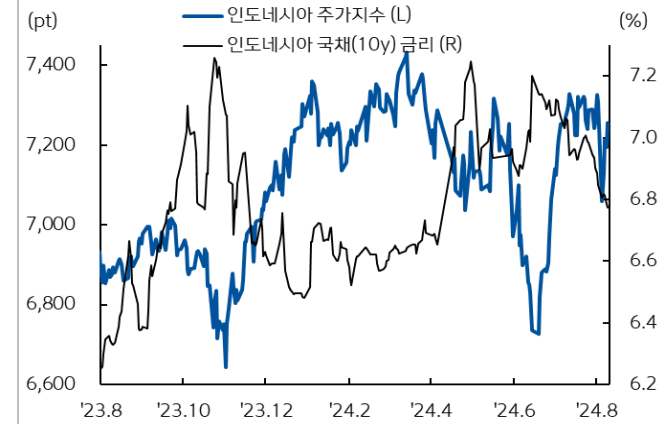
- 지난 주(8/5~8/9) USD/IDR(market rate)는 15,895~16,185(블룸버그 종가), 전주 대비 강세(+1.73%)
- 엔 캐리 트레이드 청산, 기술주 실적 부진, 미 고용 부진 우려 등에 글로벌 금융 시장 변동성 높았으나 오히려 그간 약세였던 인도네시아 루피아는 주초부터 강세보였고 환율 하락 마감
- 2분기 GDP 성장률은 5.05%(yoy)로 집계, 투자와 순수출 개선되었으나 정부 지출 감소하면서 1분기 GDP(5.11%) 소폭 하회
- 외국인은 지난 주 5영업일 간(8/5~8/9) 인도네시아 주식시장과 채권시장에서 순매수 기록
 - 주식: 외국인 순매수(8/5~8/9 누적: 6,915만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 하락(-0.70%)
 - 채권: 외국인 순매수(8/5~8/7 누적: 8,863만 달러) 기록, 금리 하락(10y, 6.77%, -7.20bp)
- 일본 중앙은행 부총재가 시장 불안정한 상황에서 추가 금리 인상 자제할 방침 밝혔고 미 8월 1주차 실업청구 건수도 고용에 대한 우려 불식시켜 위험회피 심리 다소 개선될 수 있을 것으로 예상되며 이에 루피아도 강세 이어갈 수 있을 듯. 금주 수출입실적 발표 예정이며 수출은 전년비 3.6% 증가하는 반면 수입은 전년비 -2.25% 감소할 것으로 전망(금주 예상 레인지: 15,800~16,250)

인도네시아 루피아 환율과 달러지수 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

인도네시아 주가지수와 국채 금리 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.8.12

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-08-12	103.22	0.51	-0.84	-1.98	-0.92	0.36	1.86
	유로(EUR/USD)	2024-08-12	1.09	-0.36	0.06	1.14	1.31	0.06	-1.14
	엔화(USD/JPY)	2024-08-12	147.08	-1.97	7.31	6.21	1.54	-1.03	-4.11
	파운드(GBP/USD)	2024-08-12	1.28	-0.19	-1.82	1.54	0.97	0.54	0.17
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-08-12	0.87	-1.55	3.33	4.93	1.17	1.48	-2.80
	호주 달러(AUD/USD)	2024-08-12	0.66	1.17	-3.10	-0.51	0.66	1.34	-3.49
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-08-10	1,365.10	-0.29	1.35	0.36	-2.70	-3.60	-5.64
	중국 위안(USD/CNY)	2024-08-10	7.17	0.05	1.46	0.72	0.35	0.59	-0.95
	인도 루피(USD/INR)	2024-08-09	83.96	-0.25	-0.55	-0.53	-1.10	-1.35	-0.89
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-08-09	15,925.00	1.73	2.04	0.75	-1.82	-4.61	-3.32
	베트남 동(USD/VND)	2024-08-10	25,109.00	0.44	1.23	1.33	-2.71	-5.45	-3.35
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-08-10	5.51	3.98	-1.59	-6.66	-10.06	-10.97	-11.83
	러시아 루블(USD/RUB)	2024-08-10	88.60	-3.68	-0.85	4.47	2.88	9.31	0.98
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-08-10	39,497.54	-0.60	-1.26	-0.04	1.80	11.95	4.80
	미국 NASDAQ	2024-08-10	16,745.30	-0.18	-8.99	2.47	5.04	22.72	11.55
	미국 S&P 500	2024-08-10	5,344.16	-0.04	-4.83	2.33	6.42	19.72	12.04
	일본 NIKKEI225	2024-08-09	35,025.00	-2.46	-14.97	-8.38	-5.07	7.86	4.66
	영국 FTSE	2024-08-10	8,168.10	-0.08	-1.03	-3.15	7.85	8.56	5.62
	프랑스CAC40	2024-08-10	7,269.71	0.25	-5.89	-11.55	-5.46	-0.96	-3.63
	독일 DAX	2024-08-10	17,722.88	0.35	-5.47	-5.59	4.02	11.94	5.80
Stock - EM	한국 KOSPI	2024-08-09	2,588.43	-3.28	-9.40	-5.10	-1.22	-0.11	-2.52
	중국 상해종합	2024-08-09	2,862.19	-1.48	-3.67	-9.27	-0.13	-10.25	-3.79
	인도 Sensex	2024-08-09	79,705.91	-1.58	-1.01	9.69	12.15	22.02	10.33
	인도네시아 Jakarta	2024-08-09	7,257.00	-0.70	-0.96	2.37	-0.56	5.48	-0.22
	베트남 VN index	2024-08-09	1,223.64	-1.05	-4.46	-1.69	2.10	-0.70	8.29
	브라질 Bovespa	2024-08-10	130,614.59	3.78	1.33	2.36	2.02	10.63	-2.66
Rates - DM	미국(10y)	2024-08-09	3.94	14.94	-35.61	-51.33	-23.56	-6.83	6.07
	독일(10y)	2024-08-09	2.23	5.10	-35.50	-27.00	-15.70	-27.20	20.10
	영국(10y)	2024-08-09	3.95	11.70	-21.40	-19.70	-14.10	-42.00	40.80
	일본(10y)	2024-08-09	0.85	-9.70	-23.90	-6.50	12.70	26.90	23.90
Rates - EM	한국(10y)	2024-08-09	3.01	4.20	-18.80	-54.50	-39.30	-76.40	-16.30
	인도(10y)	2024-08-09	6.88	-1.20	-10.60	-25.00	-22.40	-29.20	-29.20
	인도네시아(10y)	2024-08-09	6.77	-7.20	-28.90	-19.30	15.70	44.30	29.40
	베트남(10y)	2024-08-09	2.85	-2.00	-2.00	-2.00	43.00	32.00	48.00
	러시아(10y)	2024-06-20	15.45	45.28	136.68	228.34	359.60	442.91	358.28
	브라질(10y)	2024-08-09	11.54	-22.80	-26.40	-17.90	72.10	70.00	117.20
Commodity	WTI	2024-08-12	76.96	5.51	-6.39	-1.66	0.05	-7.49	7.41
	브렌트유	2024-08-12	79.68	4.43	-6.29	-3.76	-2.83	-8.21	3.43
	금	2024-08-12	2,428.51	0.74	0.71	3.95	20.22	27.34	17.72

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