

Weekly Global FX Market Monitor

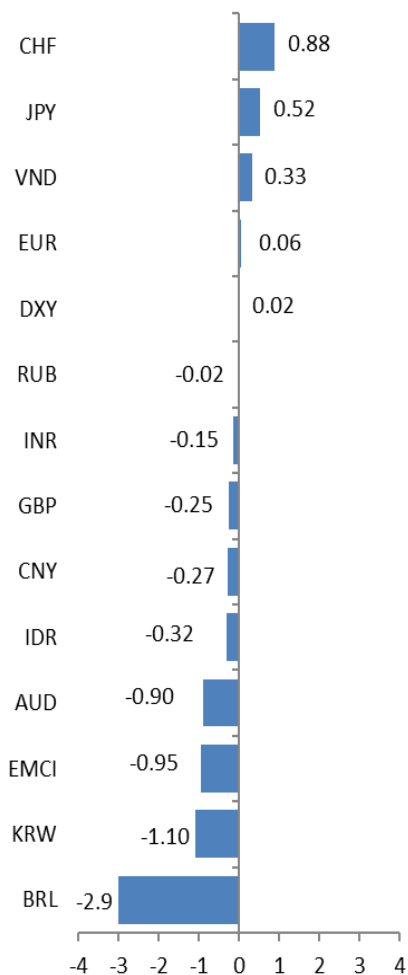
2024.7.22



Global

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

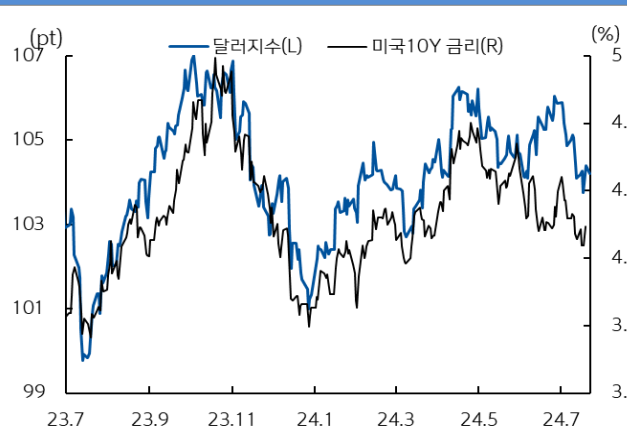
주간변동률(%)



주 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(7/15~7/19) 글로벌 외환시장은 달러 강보합(+0.2%), 유로 강보합(+0.06%), 엔화 강세(+0.52%)
 - 미 경기지표 확인 후 연준의 금리 인하 기대감 이어지고 있으나 트럼프 대세론이 달러화에 상반된 압력을 가하며 달러 인덱스는 104pt선 마감
 - ECB는 7월 정책회의에서 금리 동결했고 향후 인하도 데이터에 의존할 것이라 밝히자 시장 반응 크지 않았음. 유로존 경제 지표가 기대를 밑돌고 있으나 인플레이션 하방 경직된 양상. 유로화는 강보합 마감
 - 미 6월 CPI와 일본 외환 당국의 개입 여파로 엔화 환율은 달러당 158엔 대에 머물렀으나 트럼프가 인터뷰에서 엔화 약세를 강력하게 비판하자 엔화 환율 하락했고 157.4엔 마감
- 미국 대선 불확실성으로 위험 심리 일부 악화되었고 글로벌 IT 장애 발생 역시 신흥 통화에 부정적인 영향 미치며 신흥국통화지수(-0.95%)는 하락
 - 브라질 룰라 대통령이 인터뷰에서 재정 준칙 준수할 필요가 없다고 발언하자 브라질 재정 적자에 대한 우려 높아졌고 이에 브라질 헤알(-2.9%)은 약세 보임
 - 전주 인도 루피(-0.15%)와 인도네시아 루피아(-0.32%)는 약세 보였고 베트남 동(+0.33%)은 강세 보임

미국 국채 금리와 달러 지수 추이

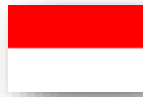


자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

유로화와 엔화 환율 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



Indonesia

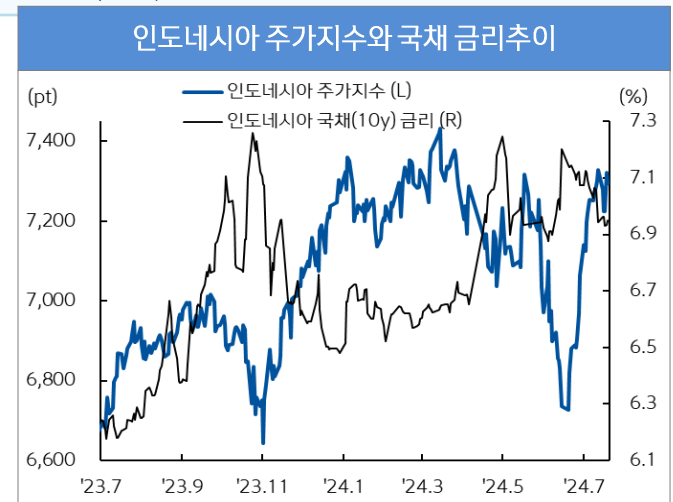
신한인도네시아은행 자금부 이상훈
021-2975-1716
sanghoonlee@shinhan.com

환율(USD/IDR)	16,190
52주최고	16,478
52주최저	14,992
주가(Jakarta index)	7,294
52주최고	7,454
52주최저	6,640
국채금리(10년물,%)	6.95
52주최고	7.26
52주최저	6.21
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	5.11
소비자물가(% YoY)	2.51
생산자물가(% YoY)	3.36
정책금리(%)	6.25
제조업 PMI (index)	50.7
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)	140

- 지난 주(7/15~7/19) USD/IDR(market rate)는 16,100~16,190(블룸버그 종가), 전주 대비 약세(-0.32%)
- 트럼프 대세론이 힘을 받으면서 글로벌 무역 긴장 고조 우려 등으로 인도네시아 루피아는 약세 보였고 프라보워 대통령 당선인의 조카인 토마스 지원도노를 재무부 차관으로 임명한다는 소식 역시 루피아에 부정적인 영향을 미치며 루피아 환율은 상승 마감
- 중앙은행은 시장 예상대로 금리 동결. 중앙은행장은 단기적으로 통화정책의 초점이 환율 안정과 해외 자본 유입에 맞춰져 있다고 발언
- 외국인 투자자는 지난 주 5영업일 간(7/15~7/19) 인도네시아 주식시장에서 순매수 채권시장에서 순매도 기록
 - 주식: 외국인 순매수(7/15~7/19 누적: 9,701만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 하락(-0.45%)
 - 채권: 외국인 순매도(7/15~7/17 누적: 8,070만 달러) 기록, 금리 상승(10y, 6.96%, +0.60bp)
- 갑작스런 차관 임명 소식으로 루피아 약세 보였으나 투자자들이 토마스 지원도노의 임명을 부정적으로 인식하고 있지 않아 루피아 약세 지속되지 않을 듯. 다만 프라보워 정부의 부채 비율 상향 가능성에 대한 투자자들의 우려는 한동안 지속될 듯(금주 예상 레인지: 16,000~16,290)



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.7.22

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-07-22	104.21	0.02	-1.50	-1.76	0.85	3.10	2.84
	유로(EUR/USD)	2024-07-22	1.09	0.06	1.56	2.30	0.16	-1.48	-1.26
	엔화(USD/JPY)	2024-07-22	157.25	0.52	1.51	-1.53	-5.82	-10.03	-10.31
	파운드(GBP/USD)	2024-07-22	1.29	-0.25	1.96	4.74	1.78	0.83	1.60
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-07-22	0.89	0.88	0.56	2.70	-2.13	-2.06	-5.25
	호주 달러(AUD/USD)	2024-07-22	0.67	-0.90	0.63	3.86	1.96	-0.59	-1.66
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-07-20	1,390.65	-1.10	-0.64	-0.60	-3.72	-8.98	-7.37
	중국 위안(USD/CNY)	2024-07-20	7.27	-0.27	-0.18	-0.42	-1.05	-0.64	-2.34
	인도 루피(USD/INR)	2024-07-19	83.66	-0.15	-0.25	-0.23	-0.71	-1.87	-0.54
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-07-19	16,190.00	-0.32	1.08	0.40	-3.55	-7.38	-4.90
	베트남 동(USD/VND)	2024-07-20	25,333.00	0.33	0.47	0.38	-3.09	-6.67	-4.20
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-07-20	5.60	-3.01	-2.91	-7.07	-11.93	-14.39	-13.23
	러시아 루블(USD/RUB)	2024-07-20	87.90	-0.02	-5.01	5.93	0.06	3.57	1.79
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-07-20	40,287.53	0.72	2.90	5.35	6.01	14.36	6.89
	미국 NASDAQ	2024-07-20	17,726.94	-3.65	0.21	14.73	15.41	26.32	18.09
	미국 S&P 500	2024-07-20	5,505.00	-1.97	0.74	9.87	13.50	21.35	15.41
	일본 NIKKEI225	2024-07-19	40,063.79	-5.12	3.80	7.01	9.62	24.02	19.72
	영국 FTSE	2024-07-20	8,155.72	-1.18	-1.00	1.64	8.92	6.42	5.46
	프랑스CAC40	2024-07-20	7,534.52	-2.46	-1.23	-6.29	1.64	1.37	-0.11
	독일 DAX	2024-07-20	18,171.93	-3.07	0.05	1.74	8.92	12.33	8.48
Stock - EM	한국 KOSPI	2024-07-19	2,795.46	-2.15	0.40	6.31	13.44	7.12	5.28
	중국 상해종합	2024-07-19	2,982.31	0.37	-0.53	-2.05	8.20	-5.85	0.25
	인도 Sensex	2024-07-19	80,604.65	0.89	4.40	9.44	12.85	20.88	11.58
	인도네시아 Jakarta	2024-07-19	7,294.50	-0.45	6.02	3.12	0.64	6.01	0.30
	베트남 VN index	2024-07-19	1,264.78	-1.25	-1.34	6.26	6.93	6.65	11.93
	러시아 RTS	2024-06-21	1,151.93	0.00	-3.95	2.44	9.51	8.90	6.32
	브라질 Bovespa	2024-07-20	127,616.46	-0.99	5.17	1.63	0.80	6.16	-4.90
Rates - DM	미국(10y)	2024-07-19	4.24	5.60	1.62	-38.18	11.63	49.06	35.98
	독일(10y)	2024-07-19	2.47	-2.90	6.30	-3.30	12.50	2.90	44.30
	영국(10y)	2024-07-19	4.12	1.40	5.60	-10.70	19.40	-9.20	58.60
	일본(10y)	2024-07-19	1.04	-2.10	11.30	19.30	37.60	57.80	43.00
Rates - EM	한국(10y)	2024-07-19	3.15	-1.50	-7.30	-43.80	-26.30	-42.30	-2.30
	인도(10y)	2024-07-19	6.96	-2.40	-1.10	-26.50	-21.60	-11.20	-21.10
	인도네시아(10y)	2024-07-19	6.95	0.60	-19.30	-9.00	32.90	74.20	47.00
	베트남(10y)	2024-07-19	2.95	0.00	0.00	9.00	50.00	20.00	60.00
	러시아(10y)	2024-06-20	15.45	45.28	136.68	228.34	359.60	442.91	358.28
	브라질(10y)	2024-07-19	12.11	42.70	18.70	61.40	133.80	130.50	174.80
Commodity	WTI	2024-07-22	80.55	-1.66	-0.22	-2.78	7.13	4.52	12.42
	브렌트유	2024-07-22	82.95	-2.24	-2.69	-4.66	3.61	2.32	7.67
	금	2024-07-22	2,410.11	-0.50	3.23	3.56	19.21	23.30	16.83

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