

Weekly Global FX Market Monitor

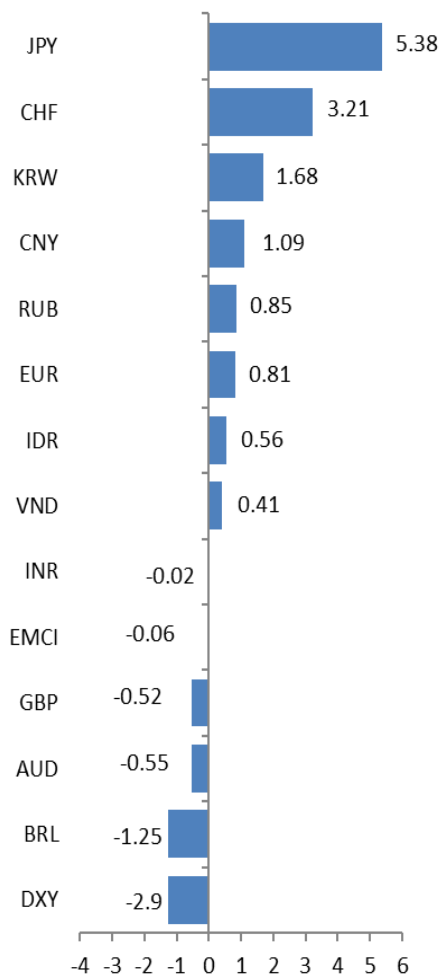
2024.8.5



Global

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

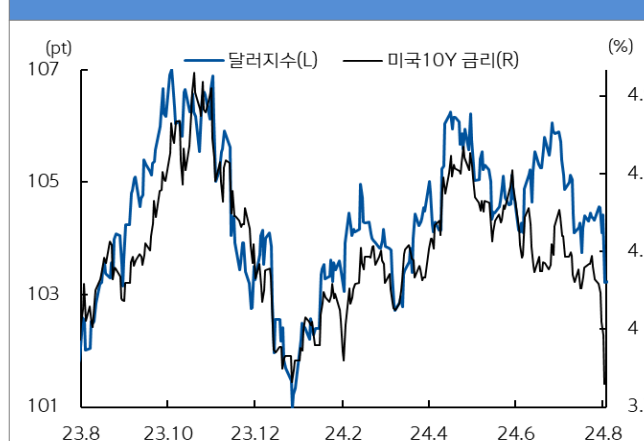
■ 주간변동률(%)



주) 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(7/29~8/2) 글로벌 외환시장은 달러 약세(-2.9%), 유로 강세(+0.81%), 엔화 강세(+5.38%)
 - 미 연준이 FOMC에서 9월 금리인하 가능성 언급했고 미 고용 지표와 제조업 지표 통해 미 경기 침체 가능성 확인하면서 미 달러는 약세 보임
 - 미 연준의 금리 인하 기대감으로 달러 인덱스 하락했고 미 경기 침체 우려 확대로 위험회피 심리 높아지자 유로화는 상승, 1.09달러대 마감
 - 지난 주 BOJ 회의에서 금리 0.25%인상했고 채권 매입 속도도 '26년 1분기 까지 현재의 절반 정도인 3조엔으로 축소하는 계획 발표. 엔화 환율은 급락했고 달러당 146.5엔대 마감
- 미 연준의 금리 인하 가능성 높아졌음에도 불구하고 미국 경기 침체 우려 확대, 엔화 강세 등으로 신흥국 통화지수(-0.06%) 혼조세 보임
 - 7월 제조업 PMI 부진에도 불구하고 BOJ의 금리 인상으로 인한 엔화 강세에 영향 받아 중국 위안(+1.09%)은 강세 보임
 - 전주 인도(-0.02%) 루피는 약세, 베트남 동(+0.41%)과 인도네시아 루피아(0.56%)는 강세 보임

미국 국채 금리와 달러 지수 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

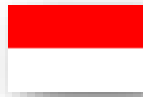
유로화와 엔화 환율 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

Weekly Global FX Market Monitor

2024. 8. 5



Indonesia

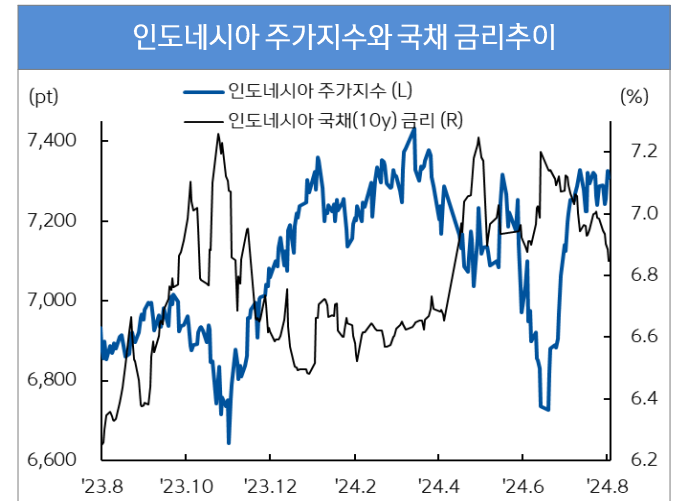
신한인도네시아은행 자금부 이상훈
021-2975-1716
sanghoonlee@shinhan.com

환율(USD/IDR)	16,200
52주최고	16,478
52주최저	15,164
주가(Jakarta index)	7,308
52주최고	7,454
52주최저	6,640
국채금리(10년물,%)	6.85
52주최고	7.26
52주최저	6.30
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	5.11
소비자물가(% YoY)	2.13
생산자물가(% YoY)	3.36
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)	140

- 지난 주(7/29~8/2) USD/IDR(market rate)는 16,200~16,300(블룸버그 종가), 전주 대비 강세(+0.56%)
- 미 연준 지난 주 FOMC에서 금리 동결했지만 이르면 9월 금리 인하 가능하다고 언급했고 일본 중앙은행 금리 인상. 대부분 강세보인 아시아 통화와 연동하여 인도네시아 루피아도 전주 강세 보임
- 7월 제조업 PMI는 49.3으로 집계되며 기준선 50 하회. 7월 소비자물가상승률은 2.13%로 전월치(2.51%) 하회하며 둔화세 이어짐
- 외국인은 지난 주 5영업일 간(7/29~8/2) 인도네시아 주식시장과 채권시장에서 순매수 기록
 - 주식: 외국인 순매수(7/29~8/2 누적: 1억 7,112만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 상승(+0.27%)
 - 채권: 외국인 순매수(7/29~7/30 누적: 1억 1,033만 달러) 기록, 금리 상승(10y, 6.85%, -13.80bp)
- 미국의 7월 비농업 고용 데이터가 시장 예상치 하회하면서 미 경제 둔화에 대한 우려 높아지고 있는 상황. 지정학적 긴장감도 고조되고 있고, 미 빅테크 주식도 하락하고 있어 미 연준의 금리 인하 기대보다 위험회피 심리가 강화될 경우, 인도네시아 루피아 약세 보일 수 있음 (금주 예상 레인지: 16,100~16,420)



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.8.5

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-08-05	103.23	-1.28	-1.57	-1.72	-1.17	1.18	1.87
	유로(EUR/USD)	2024-08-05	1.09	0.81	0.64	1.30	1.55	-0.85	-1.18
	엔화(USD/JPY)	2024-08-05	146.16	5.38	9.98	5.31	1.72	-2.50	-3.50
	파운드(GBP/USD)	2024-08-05	1.28	-0.52	-0.16	1.85	2.07	0.09	0.50
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-08-05	0.86	3.21	4.33	5.57	1.42	1.67	-1.99
	호주 달러(AUD/USD)	2024-08-05	0.65	-0.55	-3.50	-1.69	0.46	-0.91	-4.39
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-08-03	1,361.15	1.68	1.89	1.08	-2.85	-4.61	-5.37
	중국 위안(USD/CNY)	2024-08-03	7.17	1.09	1.38	0.96	0.30	0.27	-1.01
	인도 루피(USD/INR)	2024-08-02	83.75	-0.02	-0.29	-0.33	-0.98	-1.39	-0.64
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-08-02	16,200.00	0.56	1.20	-0.09	-3.35	-6.33	-4.96
	베트남 동(USD/VND)	2024-08-03	25,219.00	0.40	0.94	0.65	-3.43	-5.88	-3.77
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-08-03	5.73	-1.25	-0.90	-10.76	-13.23	-16.02	-15.20
	러시아 루블(USD/RUB)	2024-08-03	85.34	0.85	2.91	9.19	6.33	10.20	4.84
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-08-03	39,737.26	-2.10	0.92	2.74	3.54	13.32	5.43
	미국 NASDAQ	2024-08-03	16,776.16	-3.35	-8.59	3.84	7.56	20.76	11.76
	미국 S&P 500	2024-08-03	5,346.56	-2.06	-3.96	4.27	8.17	19.40	12.09
	일본 NIKKEI225	2024-08-02	35,909.70	-4.67	-12.23	-6.08	-1.22	11.55	7.31
	영국 FTSE	2024-08-03	8,174.71	-1.34	-0.36	-0.47	7.38	8.07	5.71
	프랑스CAC40	2024-08-03	7,251.80	-3.54	-5.52	-8.87	-4.46	-0.86	-3.86
	독일 DAX	2024-08-03	17,661.22	-4.11	-4.41	-1.89	4.48	10.72	5.43
Stock - EM	한국 KOSPI	2024-08-02	2,676.19	-2.04	-6.50	-0.02	3.28	2.82	0.79
	중국 상해종합	2024-08-02	2,905.34	0.50	-1.51	-6.43	7.52	-11.64	-2.34
	인도 Sensex	2024-08-02	80,981.95	-0.43	1.23	9.62	12.90	23.22	12.10
	인도네시아 Jakarta	2024-08-02	7,308.12	0.27	0.75	2.43	1.52	6.64	0.49
	베트남 VN index	2024-08-02	1,236.60	-0.44	-3.62	1.28	4.26	0.87	9.44
	브라질 Bovespa	2024-08-03	125,854.09	-1.29	-0.33	-2.07	-1.36	5.31	-6.21
Rates - DM	미국(10y)	2024-08-02	3.79	-40.35	-64.12	-79.07	-22.95	-28.71	-8.87
	독일(10y)	2024-08-02	2.17	-23.30	-42.90	-36.70	-6.70	-36.10	15.00
	영국(10y)	2024-08-02	3.83	-27.20	-42.00	-45.80	-9.00	-57.50	29.10
	일본(10y)	2024-08-02	0.95	-11.70	-13.60	4.90	27.80	32.20	33.60
Rates - EM	한국(10y)	2024-08-02	2.97	-13.40	-31.00	-67.20	-32.00	-81.00	-20.50
	인도(10y)	2024-08-02	6.89	-4.80	-11.80	-26.60	-16.10	-25.80	-28.00
	인도네시아(10y)	2024-08-02	6.85	-13.80	-27.80	-33.80	32.40	58.90	36.60
	베트남(10y)	2024-08-02	2.87	-3.00	0.00	-6.00	46.00	31.00	50.00
	러시아(10y)	2024-06-20	15.45	45.28	136.68	228.34	359.60	442.91	358.28
	브라질(10y)	2024-08-02	11.77	-32.90	-54.40	12.10	107.00	107.40	140.00
Commodity	WTI	2024-08-05	73.97	-2.43	-11.05	-5.30	1.64	-10.69	3.24
	브렌트유	2024-08-05	77.28	-3.13	-10.70	-6.85	-0.91	-10.39	0.31
	금	2024-08-05	2,445.77	2.58	2.24	5.24	20.77	26.29	18.56

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