

Weekly Global FX Market Monitor

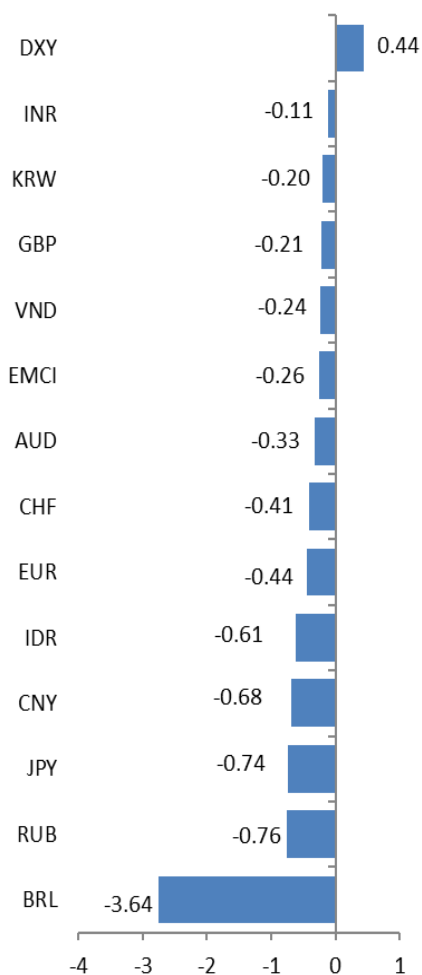
2024. 10. 14



Global

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

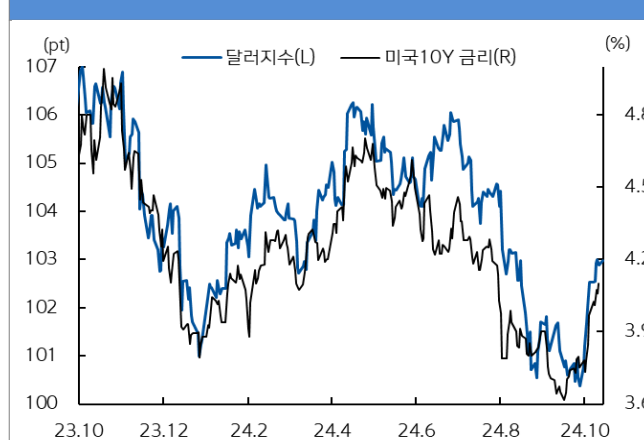
■ 주간변동률(%)



주) 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(10/7~10/11) 글로벌 외환시장은 달러 강세(+0.44%), 유로 약세(-0.44%), 엔화 약세(-0.74%)
 - 미 경제 연착륙 기대감 높아지는 가운데 FOMC 의사록을 통해 빅컷 관련하여 위원들 간 이견 있었던 것 확인. 소비자물가지수도 시장 예상치 상회하여 빅컷 기대감 소멸. 달러 인덱스는 102.89대 마감
 - 유로 지역 경기 및 인플레이션 둔화가 유럽중앙은행의 금리 인하 기대 높이고 있고 미 경제에 대한 기대감 및 중동지역 긴장감이 미달러 강세로 이어지면서 유로 환율은 하락. 유로 환율은 1.093달러 마감
 - 미국채 금리 상승으로 엔화 약세 이어지고 있으며 시장은 BOJ의 통화정책 정상화까지 시간이 필요할 것으로 예상. 전주에도 엔화는 약세 보임
- 해소되지 않고 있는 중동지역 긴장감과 연착륙에 가까운 미 경제지표 등으로 신흥국 통화지수(-0.26%)는 하락
 - 국경절 연휴 후 후속 부양책 부재, 미 달러 강세 등으로 중국 위안(-0.68%)은 약세 보임. 지난 주말 중국 재정부부는 재정지출 확대, 국채 발행 등 발표했으나 구체적인 계획 부재하여 시장은 실망
 - 전주 인도 루피(-0.11%), 베트남 동(-0.24%), 인도네시아 루피아(-0.61%) 모두 약세 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. 10. 14

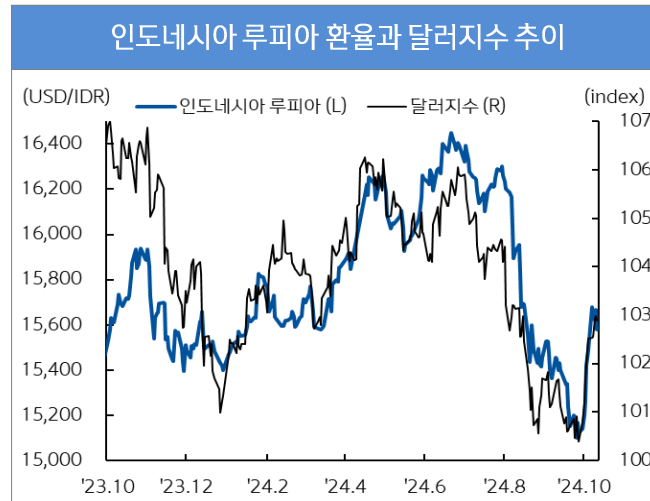


Indonesia

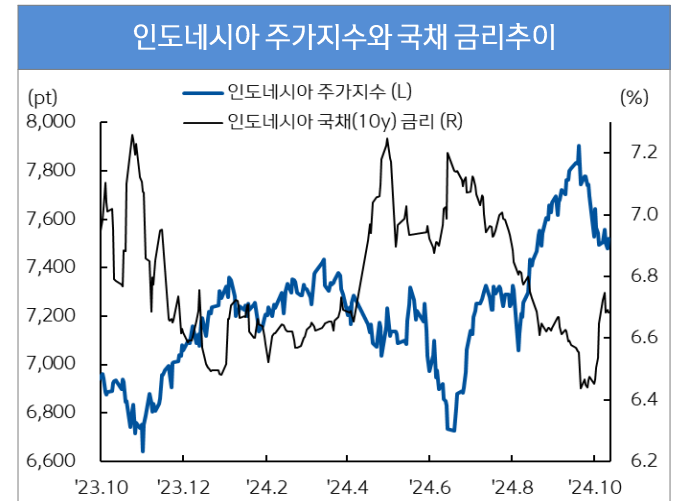
신한인도네시아은행 자금부 이상훈
021-2975-1716
sanghoonlee@shinhan.com

환율(USD/IDR)	15,580
52주최고	16,478
52주최저	15,070
주가(Jakarta index)	7,521
52주최고	7,911
52주최저	6,640
국채금리(10년물,%)	6.68
52주최고	7.26
52주최저	6.43
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	5.05
소비자물가(% YoY)	1.84
생산자물가(% YoY)	2.20
정책금리(%)	6.00
제조업 PMI (index)	49.2
산업생산(% YoY)	-0.62
소매판매(% YoY)	5.80
수출(% YoY)	7.13
수입(% YoY)	9.46
경상수지(백만달러)	-3,021
재정수지(십억루피아)	-460,420
외환보유고(십억달러)	150

- 지난 주(10/7~10/11) USD/IDR(market rate)는 15,580~15,680(블룸버그 종가), 전주 대비 약세(-0.61%)
- 중동지역 전운 고조 및 연착륙이 예상되는 미 경제 등으로 미 달러 강세 보였고 루피아 환율 약세 보였으나 인도네시아 중앙은행의 외환시장 개입으로 환율 상승폭 크지 않았음
- 외국인은 지난 주 5영업일 간(10/7~10/11) 인도네시아 주식시장에서 순매도 채권시장에서 순매수 기록
 - 주식: 외국인 순매도(10/7~10/11 누적: 2억 9,099만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 상승(+0.54%)
 - 채권: 외국인 순매수(10/7~10/10 누적: 4,612만 달러) 기록, 금리 상승(10y, 6.68%, +3.40bp)
- 금주 인도네시아 중앙은행(BI) 통화정책 회의 예정. 중앙은행 금리 결정시 최근 약세 보이고 있는 루피아 고려하지 않을 수 없으나 현재 수준의 금리는 인도네시아 국내 여건 고려 시 지나치게 긴축적이라는 평가
- 중국 경기부양책에 대한 실망, 해소되지 않은 중동 지역 긴장감 등으로 환율 상승 압력 여전히나 중앙은행의 외환시장 개입으로 환율 변동폭 크지 않을 듯 (금주 예상 레인지: 15,350~15,790)



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.10.14

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-10-14	102.99	0.44	1.85	-1.06	-2.88	-3.43	1.63
	유로(EUR/USD)	2024-10-14	1.09	-0.44	-1.84	0.31	2.86	3.48	-1.01
	엔화(USD/JPY)	2024-10-14	149.29	-0.74	-5.81	5.87	3.34	0.15	-5.53
	파운드(GBP/USD)	2024-10-14	1.31	-0.21	-1.22	0.67	4.89	6.86	2.55
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-10-14	0.86	-0.41	-1.54	4.41	6.25	4.90	-1.93
	호주 달러(AUD/USD)	2024-10-14	0.67	-0.33	-0.25	-0.37	4.55	6.20	-1.13
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-10-12	1,350.95	-0.20	-0.79	1.58	0.98	-0.90	-4.65
	중국 위안(USD/CNY)	2024-10-12	7.07	-0.68	0.74	2.70	2.41	3.31	0.47
	인도 루피(USD/INR)	2024-10-11	84.07	-0.11	-0.11	-0.60	-1.04	-1.05	-1.02
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-10-11	15,580.00	-0.61	-1.16	3.95	1.70	0.73	-1.17
	베트남 동(USD/VND)	2024-10-11	24,815.00	-0.24	-0.91	2.47	0.71	-1.59	-2.20
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-10-12	5.61	-2.76	0.92	-3.07	-9.24	-9.99	-13.43
	러시아 루블(USD/RUB)	2024-10-12	95.80	-0.76	-4.45	-8.45	-2.64	2.61	-6.61
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-10-12	42,863.86	1.21	3.55	7.16	12.85	27.30	13.73
	미국 NASDAQ	2024-10-12	18,342.94	1.13	3.73	-0.30	13.40	36.81	22.19
	미국 S&P 500	2024-10-12	5,815.03	1.11	3.36	3.56	13.50	34.37	21.91
	일본 NIKKEI225	2024-10-11	39,605.80	2.51	8.27	-3.85	0.21	22.56	18.35
	영국 FTSE	2024-10-12	8,253.65	-0.33	-0.23	0.01	3.23	8.61	6.73
	프랑스CAC40	2024-10-12	7,577.89	0.48	1.51	-1.90	-5.40	8.20	0.46
	독일 DAX	2024-10-12	19,373.83	1.32	3.61	3.34	8.05	27.57	15.65
Stock - EM	한국 KOSPI	2024-10-11	2,596.91	1.37	0.83	-9.10	-3.17	5.73	-2.20
	중국 상해종합	2024-10-11	3,217.74	4.22	19.00	8.29	6.57	4.20	8.16
	인도 Sensex	2024-10-11	81,381.36	-0.38	-1.82	1.07	9.61	22.78	12.65
	인도네시아 Jakarta	2024-10-11	7,520.60	0.33	-3.73	2.63	3.21	8.57	3.41
	베트남 VN index	2024-10-11	1,288.39	1.40	2.93	0.60	0.92	11.58	14.02
	브라질 Bovespa	2024-10-12	129,992.29	-1.37	-3.63	0.85	3.21	12.30	-3.12
Rates - DM	미국(10y)	2024-10-11	4.10	13.31	44.69	-10.98	-48.62	-45.79	22.12
	독일(10y)	2024-10-11	2.27	5.50	15.30	-19.80	-19.80	-45.30	24.10
	영국(10y)	2024-10-11	4.21	7.70	44.60	13.30	0.60	-12.10	67.00
	일본(10y)	2024-10-11	0.95	6.60	9.60	-13.80	8.10	18.30	33.80
Rates - EM	한국(10y)	2024-10-11	3.08	8.20	13.90	-14.50	-51.00	-106.00	-9.80
	인도(10y)	2024-10-11	6.79	-4.30	-3.50	-19.10	-32.00	-51.40	-38.20
	인도네시아(10y)	2024-10-11	6.68	3.40	9.40	-31.90	2.90	-10.90	20.30
	베트남(10y)	2024-10-11	2.76	0.00	-5.00	-13.00	-7.00	-20.00	39.00
	러시아(10y)	2024-06-20	15.45	45.28	136.68	228.34	359.60	442.91	358.28
	브라질(10y)	2024-10-11	12.53	21.90	66.60	88.50	102.40	83.90	216.80
Commodity	WTI	2024-10-14	74.50	-3.42	8.52	-9.38	-13.03	-15.04	3.98
	브렌트유	2024-10-14	77.94	-3.69	8.84	-8.34	-13.83	-14.25	1.17
	금	2024-10-14	2,650.56	0.30	2.64	9.42	11.21	38.04	28.48

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