

Weekly Global FX Market Monitor

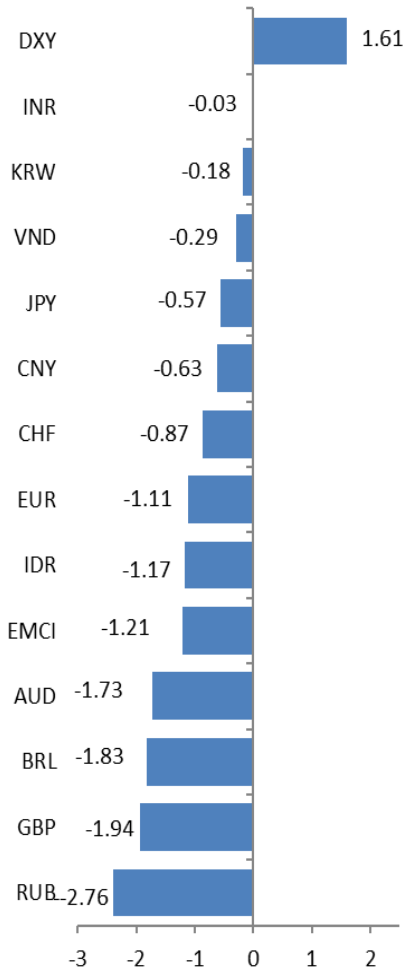
2024.11.18



Global

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

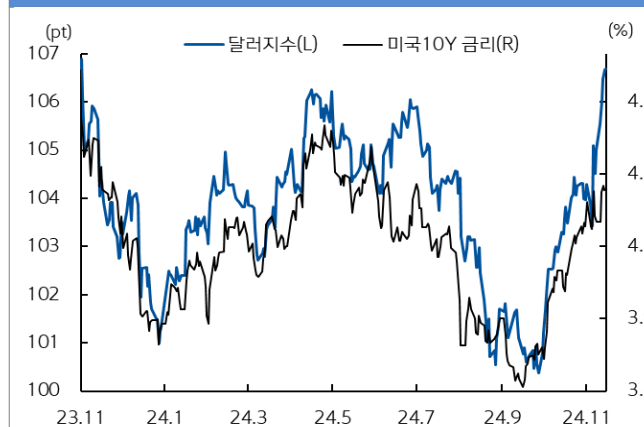
■ 주간변동률(%)



주 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(11/11~11/15) 글로벌 외환시장은 달러 강세(+1.61%), 유로 약세(-1.11%), 엔화 약세(-0.57%)
 - 트럼프 정책 경계감에 더해 금리 인하 서두르지 않겠다는 파월 의장의 발언도 미국 정책 불확실성 높은 가운데 미 달러는 미국채 시장 금리 상승에 동반하여 광범위한 상승세 지속
 - 유로존 9월 산업생산은 전월비 -2%로 집계되며 시장 예상보다 위축. 트럼프 당선이 유럽에 악재라는 인식 속에 전주 유로화는 급락
 - 일본의 3분기 GDP 성장률은 전분기 대비 연율 0.9%로 예상치를 상회했으나 GDP 디플레이터는 전년대비 2.5%로 예상 하회. 한때 엔화 환율은 달러당 156엔대까지 상승했으나 주 후반 하락하여 154엔대 마감
- 트럼프의 미국 우선주의에 따른 미국 경제성장률에 대한 기대로 미 주식 상승, 인플레이션 우려로 인한 미국채 금리 상승 경계감 등에 미달러 강세 보였고 이에 신흥국 통화지수(-1.21%)는 하락
 - 중국 당국은 고시환율을 통해 위안(-0.63%) 방어 의지 보였고 국영은행을 통한 달러 매도 역시 병행한 것으로 추정되나 트럼프 트레이드로 금주에도 위안 환율 상승
 - 전주 인도 루피(-0.03%), 베트남 동(-0.29%), 인도네시아 루피아(-1.17%) 모두 약세 보임

미국 국채 금리와 달러 지수 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

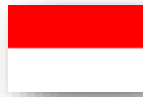
유로화와 엔화 환율 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

Weekly Global FX Market Monitor

2024.11.18



Indonesia

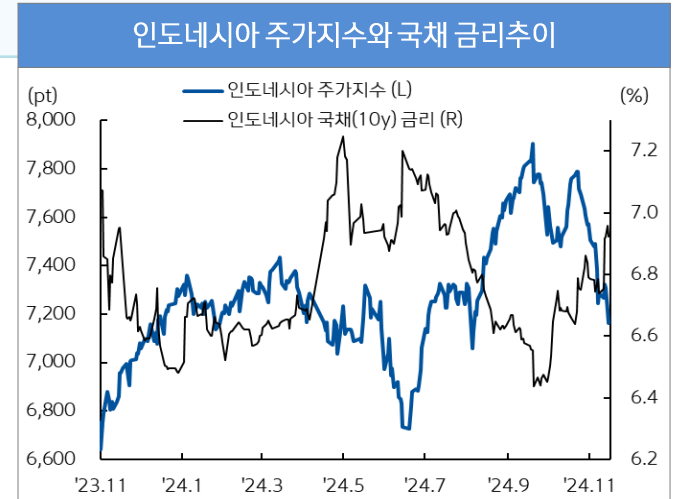
신한인도네시아은행 자금부 이상훈
021-2975-1716
sanghoonlee@shinhan.com

환율(USD/IDR)	15,855
52주최고	16,478
52주최저	15,070
주가(Jakarta index)	7,161
52주최고	7,911
52주최저	6,699
국채금리(10년물,%)	6.92
52주최고	7.25
52주최저	6.43
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	4.95
소비자물가(% YoY)	1.71
생산자물가(% YoY)	1.95
정책금리(%)	6.00
제조업 PMI (index)	49.2
산업생산(% YoY)	-0.62
소매판매(% YoY)	4.70
수출(% YoY)	10.25
수입(% YoY)	17.49
경상수지(백만달러)	-3,021
재정수지(십억루피아)	-337,288
외환보유고(십억달러)	151

- 지난 주(11/11~11/15) USD/IDR(market rate)는 15,680~15,855(블룸버그 증가), 전주 대비 약세(-1.17%)
- 트럼프 트레이드 연장되며 미국 주식 상승, 트럼프 정책 경계감으로 미국채 금리 상승, 미달러 강세. 이에 대부분 신흥국 통화 약세 보였으며 인도네시아 루피아 환율도 상승. 루피아 환율이 한때 달러당 16,000 루피아 근처까지 상승하자 중앙은행 개입했고 환율 소폭 하락
- 외국인은 지난 5영업일 간(11/11~11/15) 인도네시아 주식시장과 채권시장에서 순매도 기록
 - 주식: 외국인 순매도(11/11~11/15 누적: 2억 9,339만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 하락(-1.73%)
 - 채권: 외국인 순매도(11/11~11/12 누적: 1억 1,608만 달러) 기록, 금리 상승(10y, 6.92%, +18.20bp)
- 이번 주 중앙은행 11월 통화정책 회의 예정되어 있으며 금리 동결할 것으로 전망. 국내 상황 고려 시, 인도네시아 금리 다소 높은 수준이지만 강달러로 인해 루피아 환율 불안정해 금리 동결할 듯
- 트럼프 트레이드 지속 여부가 금주 환율 방향성 결정할 듯. 중앙은행은 환율이 달러당 16,000 루피아 선까지 상승하는 것을 경계하고 있는 가운데 금번 회의에서 금리 동결 예상되고 특별한 대외 이벤트 없어 루피아 환율 하락에 무게 (금주 예상 레인지: 15,560~15,900)



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.11.18

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-11-15	106.69	1.61	3.32	3.60	2.24	2.20	5.28
	유로(EUR/USD)	2024-11-18	1.05	-1.11	-3.04	-4.94	-2.95	-3.68	-4.55
	엔화(USD/JPY)	2024-11-18	154.60	-0.57	-3.28	-5.18	1.07	-4.02	-8.77
	파운드(GBP/USD)	2024-11-18	1.26	-1.94	-3.32	-2.86	-0.68	0.91	-0.88
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-11-18	0.89	-0.87	-2.65	-2.87	2.51	-0.37	-5.28
	호주 달러(AUD/USD)	2024-11-18	0.65	-1.73	-3.65	-4.01	-3.09	-1.46	-5.15
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-11-16	1,398.45	-0.18	-2.41	-2.69	-2.10	-6.99	-7.89
	중국 위안(USD/CNY)	2024-11-16	7.23	-0.63	-1.52	-0.76	-0.14	0.24	-1.79
	인도 루피(USD/INR)	2024-11-14	84.41	-0.03	-0.41	-0.54	-1.06	-1.27	-1.42
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-11-15	15,855.00	-1.17	-1.73	-1.01	1.09	-2.02	-2.89
	베트남 동(USD/VND)	2024-11-18	25,385.00	-0.29	-0.87	-1.62	0.27	-4.62	-4.40
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-11-15	5.80	-1.83	-3.50	-5.57	-11.51	-16.07	-16.20
	러시아 루블(USD/RUB)	2024-11-16	100.00	-2.40	-3.00	-11.16	-8.81	-10.49	-10.53
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-11-16	43,444.99	-1.24	0.39	6.85	8.60	24.32	15.27
	미국 NASDAQ	2024-11-16	18,680.12	-3.15	1.03	5.95	11.95	32.24	24.44
	미국 S&P 500	2024-11-16	5,870.62	-2.08	0.10	5.70	10.70	30.05	23.08
	일본 NIKKEI225	2024-11-15	38,642.91	-2.17	-0.87	1.52	-0.37	15.06	15.48
	영국 FTSE	2024-11-16	8,063.61	-0.11	-3.53	-2.98	-4.24	7.45	4.27
	프랑스CAC40	2024-11-16	7,269.63	-0.94	-4.51	-2.42	-10.99	0.49	-3.63
	독일 DAX	2024-11-16	19,210.81	-0.02	-2.27	4.85	2.71	20.68	14.68
	Stock - EM	한국 KOSPI	2024-11-15	2,416.86	-5.63	-6.82	-10.39	-11.30	-2.15
중국 상해종합		2024-11-15	3,330.73	-3.52	2.12	15.67	5.60	9.05	11.96
인도 Sensex		2024-11-14	77,580.31	-2.47	-5.18	-1.93	6.29	18.13	7.39
인도네시아 Jakarta		2024-11-15	7,161.26	-1.73	-7.72	-3.64	-2.13	2.63	-1.53
베트남 VN index		2024-11-15	1,218.57	-2.71	-5.20	-2.69	-4.28	10.66	7.84
브라질 Bovespa		2024-11-15	127,791.60	-1.46	-2.48	-4.74	-0.18	3.76	-4.76
Rates - DM	미국(10y)	2024-11-15	4.44	13.51	40.77	52.63	9.94	-9.20	56.03
	독일(10y)	2024-11-15	2.36	-1.10	13.40	9.30	-6.60	-28.80	33.20
	영국(10y)	2024-11-15	4.47	3.60	30.90	54.80	40.50	24.40	93.40
	일본(10y)	2024-11-15	1.07	6.40	10.00	23.40	11.70	27.10	45.90
Rates - EM	한국(10y)	2024-11-15	3.08	4.30	3.30	14.00	-46.50	-73.70	-9.50
	인도(10y)	2024-11-14	6.86	5.30	8.10	0.50	-24.30	-41.70	-31.00
	인도네시아(10y)	2024-11-15	6.92	18.20	22.60	19.30	-5.60	-3.00	44.20
	베트남(10y)	2024-11-15	2.85	1.00	9.00	1.00	-3.00	5.00	48.00
	러시아(10y)	2024-06-20	15.45	45.28	136.68	228.34	359.60	442.91	358.28
	브라질(10y)	2024-11-14	12.90	35.80	45.00	145.40	127.60	174.10	253.50
Commodity	WTI	2024-11-15	67.02	-4.77	-5.04	-14.25	-14.77	-12.58	-6.46
	브렌트유	2024-11-15	71.04	-3.83	-4.32	-12.34	-14.15	-12.49	-7.79
	금	2024-11-18	2,569.26	-1.89	-5.59	2.59	5.94	29.89	24.54

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