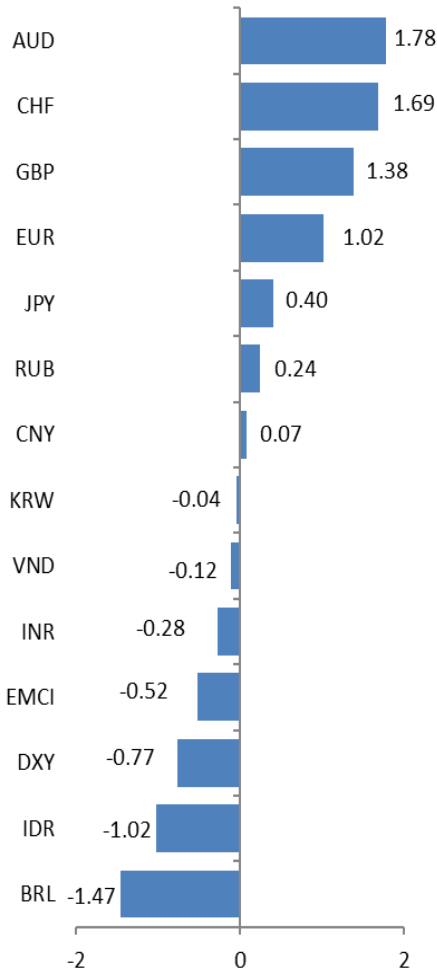




Global

■ 주간변동률(%)



주) 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(10/3~10/9) 글로벌 외환시장은 달러 약세(-0.77%), 유로 강세(+1.02%), 엔화 강세(+0.40%) 변동
 - 미 연준의 추가 금리 인상 우려에 107pt 선까지 상승했던 달러 인덱스는 금리 급등으로 인한 연착륙 기대 저하감에 반락했으나 이스라엘-팔레스타인 전쟁으로 인한 안전자산 선호에 소폭 상승
 - 미국채 금리 상승으로 주중 1.045 달러까지 하락했던 유로화는 미 국채 금리 상승세 진정에 1.057 달러 대까지 상승
 - 미국채 급등에 엔화 환율 상승했으나 주 후반 미 금리 반락과 중동 지역 지정학적 위험 확대에 따른 안전자산 매수세 유입에 달러당 148엔 마감
- 미 국채 금리 급등 진정되었으나 여전히 미 고금리 전망 이어지고 있어 신흥국 통화는 약세 지속
 - 이스라엘과 팔레스타인의 무력 충돌로 국제유가 급등. 미 엘렌 장관은 러시아 원유 가격 상한제 집행 강화할 것이라 발표. 러시아(+0.24%)는 전주 강세 보임
 - 인도 루피(-0.28%), 베트남 동(-0.12%), 인도네시아 루피아(-1.02%) 모두 약세 보임

미국 국채 금리와 달러 지수 추이

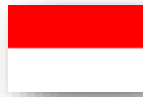


자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

유로화와 엔화 환율 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



Indonesia

환율(USD/IDR)	15,690
52주최고	15,763
52주최저	14,575
주가(Jakarta index)	6,891
52주최고	7,128
52주최저	6,543
국채금리(10년물,%)	7.02
52주최고	7.69
52주최저	6.16
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	5.17
소비자물가(% YoY)	2.28
생산자물가(% YoY)	3.28
정책금리(%)	5.75
제조업 PMI (index)	52.3
산업생산(% YoY)	-1.26
소매판매(% YoY)	1.30
수출(% YoY)	-21.21
수입(% YoY)	-14.77
경상수지(백만달러)	-1,900
재정수지(십억루피아)	-775,064
외환보유고(십억달러)	135

- 지난 주(10/3~10/9) USD/IDR(market rate)는 15,580~15,690호름(블룸버그 종가), 전주 대비 약세(-1.02%)
- 예상보다 강한 9월 미 비농업고용 확인 후 미 연준의 고금리 장기 전망이 이어지면서 전주에도 인도네시아 루피아 약세 보임. 인도네시아 중앙은행이 루피아 방어를 위해 외환시장에 개입하면서 9월 한달 외환보유액은 20억 달러 감소. 이스라엘-팔레스타인 전쟁으로 인한 지정학적 불안 확대도 루피아 약세 요인으로 작용
- 외국인 은 지난 주 5영업일 간(10/3~10/9) 인도네시아 주식시장과 채권시장에서 순매도 기록
 - 주식: 외국인 순매도(10/3~10/9 누적: 1,537만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 하락(-1.01%)
 - 채권: 외국인 순매도(10/3~10/6 누적: 4억 1,682만 달러) 기록, 금리 상승(10y, 7.02%, -0.20bp)
- 중앙은행은 물가 안정에도 불구하고 글로벌 자본 유출 우려에 기준 금리 동결하고 있으나 미 국채 금리 상승으로 인한 외국 자본 유출은 피할 수 없을 듯. 지정학적 불안으로 인한 안전자산 선호도 루피아 환율 상승 요인. 이번 주 발표될 미 9월 소비자물가는 8월과 비슷한 수준 유지하거나 소폭 둔화될 것으로 예상되나 9월 비농업고용처럼 시장 예상 벗어날 경우, 금주에도 루피아 환율 상승 이어질 듯 (금주 예상 레인지: 15,490~15,800)

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

2023.10.10

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2023-10-09	106.08	-0.77	0.94	3.73	4.18	-5.95	2.47
	유로(EUR/USD)	2023-10-10	1.06	1.02	-1.64	-3.88	-2.62	8.99	-1.22
	엔화(USD/JPY)	2023-10-10	148.43	0.40	-1.24	-4.80	-9.98	-1.83	-11.66
	파운드(GBP/USD)	2023-10-10	1.22	1.38	-2.12	-4.80	-1.11	10.76	1.33
	스위스프랑(USD/CHF)	2023-10-10	0.91	1.69	-1.65	-2.25	0.43	10.38	2.08
	호주 달러(AUD/USD)	2023-10-10	0.64	1.78	-0.26	-3.91	-3.42	1.76	-5.86
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2023-10-06	1,350.00	-0.04	-1.43	-3.64	-2.29	3.90	-6.26
	중국 위안(USD/CNY)	2023-10-10	7.29	0.07	-0.05	-0.91	-5.59	-1.88	-5.40
	인도 루피(USD/INR)	2023-10-09	83.27	-0.28	-0.29	-0.83	-1.54	-1.14	-0.64
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2023-10-09	15,690.00	-1.02	-2.33	-3.15	-5.02	-2.40	-0.78
	베트남 동(USD/VND)	2023-10-09	24,385.00	-0.12	-1.28	-3.03	-3.83	-2.08	-3.08
	브라질 헤알(USD/BRL)	2023-10-10	5.14	-1.47	-4.02	-4.64	-1.37	1.04	2.78
러시아 루블(USD/RUB)	2023-10-10	99.61	0.24	-3.95	-8.70	-17.86	-35.99	-25.52	
Stock - DM	미국 Dow Jones	2023-10-10	33,604.65	0.51	-2.81	-0.39	0.36	14.70	1.38
	미국 NASDAQ	2023-10-10	13,484.24	1.33	-2.01	-1.29	11.55	26.58	28.83
	미국 S&P 500	2023-10-10	4,335.66	1.10	-2.73	-1.44	5.62	19.12	12.92
	일본 NIKKEI225	2023-10-06	30,994.67	-2.71	-4.94	-4.30	12.63	14.30	18.78
	영국 FTSE	2023-10-10	7,492.21	-0.25	0.19	3.24	-3.22	7.17	0.54
	프랑스CAC40	2023-10-10	7,021.40	-0.66	-3.03	-1.27	-4.14	19.68	8.46
	독일 DAX	2023-10-10	15,128.11	-0.78	-3.92	-3.05	-3.01	23.26	8.65
Stock - EM	한국 KOSPI	2023-10-06	2,408.73	-3.49	-5.45	-4.67	-3.28	7.88	7.71
	중국 상해종합	2023-10-09	3,096.92	-1.13	-0.64	-3.33	-6.59	4.13	0.25
	인도 Sensex	2023-10-09	65,512.39	-0.48	-1.63	0.26	9.47	12.97	7.68
	인도네시아 Jakarta	2023-10-09	6,891.46	-1.01	-0.48	2.38	1.78	-1.47	0.60
	베트남 VN index	2023-10-09	1,137.36	-1.55	-8.39	-1.01	6.76	9.10	12.94
	러시아 RTS	2023-10-10	1,006.92	1.49	-0.54	3.16	3.32	0.19	3.74
브라질 Bovespa	2023-10-10	115,156.10	0.09	-0.14	-3.15	14.22	-1.05	4.94	
Rates - DM	미국(10y)	2023-10-09	4.80	12.24	53.68	73.93	141.03	91.95	92.61
	독일(10y)	2023-10-09	2.77	-15.00	16.20	13.50	58.90	57.80	20.10
	영국(10y)	2023-10-09	4.48	-8.80	5.30	-17.40	104.40	23.80	80.40
	일본(10y)	2023-10-09	0.81	2.80	15.00	37.70	33.50	55.30	38.30
Rates - EM	한국(10y)	2023-10-06	4.24	23.20	33.90	52.90	96.20	14.40	50.90
	인도(10y)	2023-10-09	7.38	14.50	17.50	22.00	17.70	-7.40	5.30
	인도네시아(10y)	2023-10-10	7.02	-0.20	46.90	76.00	33.00	-27.20	8.00
	베트남(10y)	2023-10-09	2.95	5.00	5.00	0.00	-47.00	-220.00	-200.00
	러시아(10y)	2023-10-06	12.05	11.40	50.81	87.50	113.13	320.91	174.19
브라질(10y)	2023-10-09	11.77	-6.10	47.60	111.10	-91.00	-6.60	-92.10	
Commodity	WTI	2023-10-10	86.38	-3.19	-1.29	18.34	8.33	-5.21	7.63
	브렌트유	2023-10-09	88.15	-2.82	-2.76	12.34	3.56	-9.98	2.61
	금	2023-10-10	1,861.23	2.10	-3.18	-3.33	-6.54	11.54	2.04

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