

Weekly Global FX Market Monitor

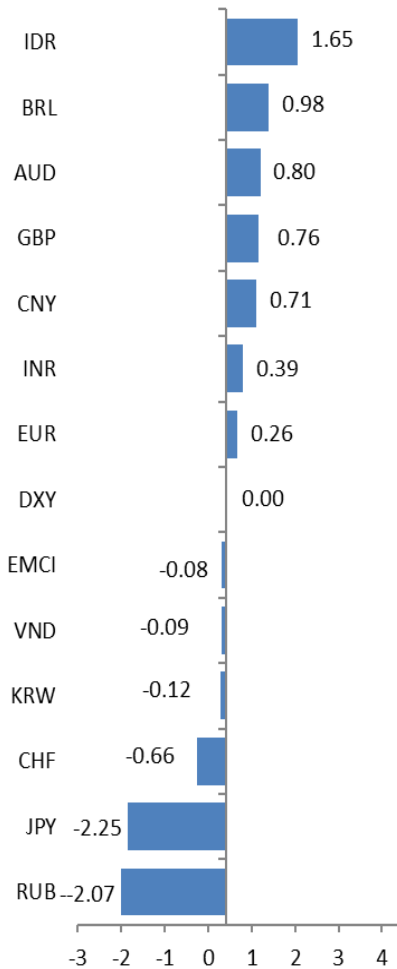
2024. 9. 23



Global

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

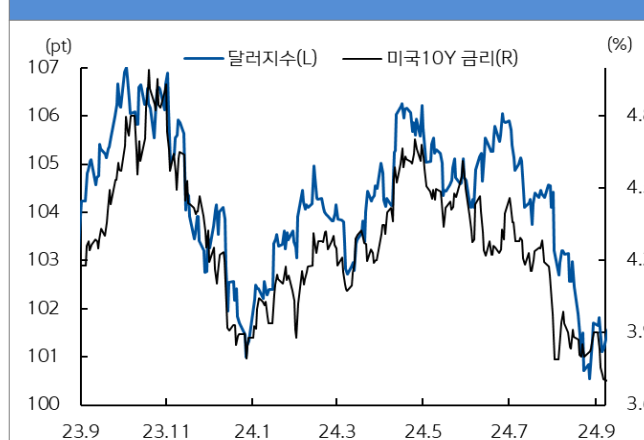
■ 주간변동률(%)



주) 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(9/16~9/20) 글로벌 외환시장은 달러 보합(0.00%), 유로 강세(+0.26%), 엔화 약세(-2.25%)
 - 미 연준은 9월 FOMC에서 빅 컷 단행하였으나 연준의 빅 컷을 고려하는 과정에서 시장이 미 경제와 세계 경제의 불확실성을 고려하면서 미 달러 가치는 지지되고 있음
 - 미 연준에 앞선 유럽중앙은행(ECB)의 금리 인하와 GDP 성장률 전망치 하향 조정에도 불구하고 ECB가 추가금리 인하에 신중한 입장을 보이면서 유로화는 강세 마감
 - 일본중앙은행(BOJ)은 9월 회의에서 시장 예상대로 금리 동결. 미 연준의 통화정책 전환에도 불구하고 BOJ 총재가 기자회견에서 비둘기파적인 발언을 하자 금리 인상 늦춰질 수 있다는 인식 높아졌고 엔화 약세 마감
- 미 연준의 금리 인하에도 불구하고 글로벌 불확실성에 대한 우려 해소되지 않아 신흥국 통화 지수(-0.08%)는 약보합 마감
 - 미 FOMC 기준금리 인하로 중국의 경기 부양 조치를 시행할 여력을 확보했다는 평가에 중국 위안(+0.71%)은 강세 마감
 - 전주 인도 루피(+0.39%)와 인도네시아 루피아(+1.65%)는 강세 보였으나 베트남 동(-0.09%)은 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. 9. 23.



Indonesia

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

환율(USD/IDR)	15,150
52주최고	16,478
52주최저	15,080
주가(Jakarta index)	7,743
52주최고	7,911
52주최저	6,640
국채금리(10년물,%)	6.44
52주최고	7.26
52주최저	6.44
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	5.05
소비자물가(% YoY)	2.12
생산자물가(% YoY)	2.82
정책금리(%)	6.00
제조업 PMI (index)	48.9
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(9/9~9/18) USD/IDR(market rate)는 15,335~15,455(블룸버그 종가), 전주 대비 강세(+0.39%)
- 인도네시아 중앙은행(BI)은 미 연준에 앞서 금리 인하 단행하였으나 미 연준의 빅 컷으로 인도네시아 자본시장 내 외국 자본 유입되고 있으며 인도네시아 루피아 강세 지속
- 인도네시아 의회는 25년 예산안으로 3,621조 루피아 (2,370억 달러 규모)를 확정. 프라보워의 주요 공약 이행 및 정부 부처 개편에 힘을 실어줄 수 있을 것으로 기대
- 외국인은 지난 주 4영업일 간(9/17~9/20) 인도네시아 주식시장과 채권시장에서 순매수 기록
 - 주식: 외국인 순매수(9/17~9/20 누적: 3억 899만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 하락(-0.71%)
 - 채권: 외국인 순매수(9/17~9/18 누적: 8억 6,505만 달러)기록, 금리 하락(10y, 6.44%,-13.90bp)
- 미 연준의 통화정책 전환이 인도네시아 루피아에 긍정적인 영향 미치고 있고 프라보워 수비안토 당선자의 취임 준비 역시 순조롭게 진행되고 있어 루피아 강세 지속될 수 있을 것으로 예상하나 고조되고 있는 중동 지역 긴장감이 금주 루피아 방향성에 변수로 작용될 수 있음(금주 예상 레인지: 15,270~15,640)

인도네시아 루피아 환율과 달러지수 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

인도네시아 주가지수와 국채 금리추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.9.23

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-09-23	100.76	0.00	0.05	-4.76	-3.51	-4.56	-0.56
	유로(EUR/USD)	2024-09-23	1.12	0.26	-0.27	4.00	3.00	5.37	1.11
	엔화(USD/JPY)	2024-09-23	143.85	-2.25	0.36	10.96	5.26	3.50	-1.95
	파운드(GBP/USD)	2024-09-23	1.33	0.76	0.78	4.97	5.39	9.06	4.60
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-09-23	0.85	-0.66	-0.29	5.01	5.76	7.24	-1.06
	호주 달러(AUD/USD)	2024-09-23	0.68	0.80	0.16	2.24	4.07	5.95	-0.09
	FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-09-21	1,335.20	-0.12	-0.33	3.70	0.33	-0.38
중국 위안(USD/CNY)		2024-09-21	7.05	0.71	1.17	3.03	2.14	3.40	0.75
인도 루피(USD/INR)		2024-09-20	83.58	0.39	0.26	0.09	-0.49	-0.59	-0.44
인도네시아 루피아(USD/IDR)		2024-09-20	15,150.00	1.65	1.88	8.45	3.73	1.54	1.63
베트남 동(USD/VND)		2024-09-20	24,602.00	-0.09	1.31	3.46	0.74	-1.27	-1.35
브라질 헤알(USD/BRL)		2024-09-21	5.51	0.98	-0.61	-1.10	-9.85	-11.45	-11.86
러시아 루블(USD/RUB)		2024-09-21	92.37	-2.42	-1.32	-5.54	0.16	4.16	-3.14
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-09-21	42,063.36	1.62	2.16	7.44	6.55	23.85	11.60
	미국 NASDAQ	2024-09-21	17,948.32	1.49	0.39	1.46	9.25	35.85	19.57
	미국 S&P 500	2024-09-21	5,702.55	1.36	1.21	4.35	8.95	32.00	19.55
	일본 NIKKEI225	2024-09-20	37,723.91	2.42	-1.67	-2.26	-7.74	16.42	12.73
	영국 FTSE	2024-09-21	8,229.99	-0.52	-1.17	-0.09	3.77	7.11	6.42
	프랑스CAC40	2024-09-20	7,500.26	0.47	-1.01	-1.68	-7.99	4.39	-0.57
	독일 DAX	2024-09-21	18,720.01	0.11	0.47	3.06	2.82	20.33	11.75
Stock - EM	한국 KOSPI	2024-09-20	2,593.37	2.77	-4.01	-6.86	-5.65	3.40	-2.33
	중국 상해종합	2024-09-20	2,736.81	0.55	-4.12	-8.72	-10.21	-12.63	-8.00
	인도 Sensex	2024-09-20	84,544.31	1.99	4.26	9.50	16.08	28.08	17.03
	인도네시아 Jakarta	2024-09-20	7,743.00	-0.71	2.63	12.54	5.34	10.35	6.47
	베트남 VN index	2024-09-20	1,272.04	1.62	-1.03	-0.78	-0.76	6.62	12.58
	브라질 Bovespa	2024-09-21	131,065.44	-2.83	-3.35	8.01	3.18	12.98	-2.32
	Rates - DM	미국(10y)	2024-09-20	3.74	9.00	-6.54	-51.81	-53.15	-66.57
독일(10y)		2024-09-20	2.21	6.00	-0.70	-22.30	-22.40	-49.40	18.40
영국(10y)		2024-09-20	3.90	13.50	-1.20	-15.40	-11.30	-31.20	36.60
일본(10y)		2024-09-20	0.85	0.20	-4.30	-10.70	10.90	12.30	23.60
Rates - EM		한국(10y)	2024-09-20	2.99	6.50	-0.80	-27.80	-44.80	-96.00
	인도(10y)	2024-09-20	6.76	-2.80	-9.40	-21.60	-32.90	-41.30	-41.20
	인도네시아(10y)	2024-09-20	6.44	-13.90	-20.20	-70.10	-21.60	-31.40	-4.20
	베트남(10y)	2024-09-20	2.78	-2.00	-6.00	-11.00	14.00	7.00	41.00
	러시아(10y)	2024-06-20	15.45	45.28	136.68	228.34	359.60	442.91	358.28
	브라질(10y)	2024-09-19	12.15	13.50	73.50	22.30	110.10	78.20	178.40
	Commodity	WTI	2024-09-23	71.00	1.30	-5.12	-12.05	-11.94	-21.14
브렌트유		2024-09-23	74.48	2.38	-5.75	-12.62	-12.82	-20.15	-3.32
금		2024-09-23	2,621.07	1.50	4.32	12.27	20.68	36.80	27.05

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