

Weekly Global FX Market Monitor

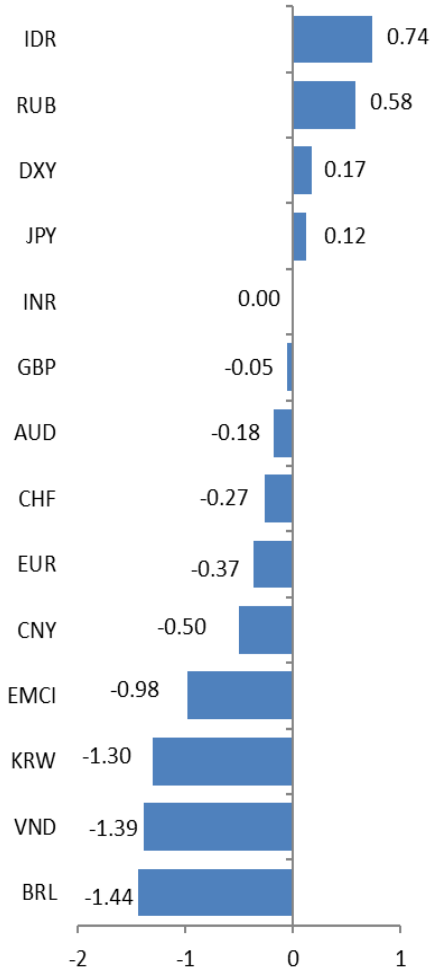
2024. 10. 21



Global

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

■ 주간변동률(%)



주) 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(10/14~10/18) 글로벌 외환시장은 달러 강세(+0.17%), 유로 약세(-0.37%), 엔화 강세(+0.12%)
 - 소매판매 등 미 경제지표 호조 보였고 트럼프 재집권 가능성이 상승하면서 트럼프 트레이딩 움직임 확인. 달러는 강세보였고 달러 인덱스는 103.49대 마감
 - ECB 시장 예상대로 기준금리 인하했고 9월 유로존 CPI 확정치는 예비치보다 소폭 하향 조정. 부진한 경제지표와 ECB의 추가 금리 인하 기대로 유로는 약세 마감
 - 미일 금리차 확대 진정에도 불구하고 광범위한 미 달러 강세로 환율 상승 이어지며 한때 엔화 환율은 달러당 150엔 상회. 9월 근원 CPI는 시장 예상치 소폭 상회했으나 시장 반응 미미
- 미 대선과 중동 정세로 시장 불확실성이 여전히 높은 상황. 트럼프 승리 가능성이 높아지면서 트럼프 관세 리스크 부각. 신흥국 통화(-0.98%)는 약세 보임
 - 중국 당국의 부양책이 시장의 기대를 충족시키지 못했고 트럼프 당선 베팅이 중국 수입관세 인상 우려로 이어지면서 중국 위안(-0.50%)은 약세 마감. 3분기 GDP 전년동기비 4.6% 성장
 - 전주 인도 루피(0.00%)는 보합, 베트남 동(-1.39%)은 약세, 인도네시아 루피아(+0.74%)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. 10. 21



Indonesia

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

환율(USD/IDR)	15,465
52주최고	16,478
52주최저	15,070
주가(Jakarta index)	7,760
52주최고	7,911
52주최저	6,640
국채금리(10년물,%)	6.66
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)	4.70
수출(%,YoY)	6.44
수입(%,YoY)	8.55
경상수지(백만달러)	-3,021
재정수지(십억루피아)	-337,288
외환보유고(십억달러)	150

- 지난 주(10/14~10/18) USD/IDR(market rate)는 15,465~15,580(블룸버그 종가), 전주 대비 강세(+0.74%)
- 양호한 미 경제 지표가 미 연준의 점진적 금리 인하 가능성을 높였고 미국 시장이 11월 미 대선에서 트럼프 승리에 베팅하면서 미 달러 강세. 미달러 강세에 대부분 아시아 통화 약세 보였으나 인도네시아 중앙은행의 금리 동결과 프라보워 정권에서의 현 정부 정책 연속성 지속될 것이란 기대에 루피아 강세
- 외국인은 지난 주 5영업일 간(10/14~10/18) 인도네시아 주식시장과 채권시장에서 순매수 기록
 - 주식: 외국인 순매수(10/14~10/18 누적: 7,845만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 상승(+3.18%)
 - 채권: 외국인 순매수(10/14~10/17 누적: 2억 4,352만 달러)기록, 금리 하락(10y, 6.66%, -2.30bp)
- 중앙은행 금리 동결하며 루피아 가치 안정에 대한 의지보였고 20일 취임한 프라보워 대통령은 안정적 국 정운영과 투자자 신뢰 강화를 위해 현 재무장관을 재임명. 중동 정세나 미대선 관련 불확실성 해소되지 않았으나 인도네시아 국내 상황 안정적으로 환율 변동성 크지 않을 것으로 예상 (금주 예상 레인지: 15,360~15,710)

인도네시아 루피아 환율과 달러지수 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

인도네시아 주가지수와 국채 금리추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.10.21

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-10-21	103.48	0.17	2.73	-0.88	-2.52	-2.53	2.12
	유로(EUR/USD)	2024-10-21	1.09	-0.37	-2.18	-0.20	2.01	1.87	-1.54
	엔화(USD/JPY)	2024-10-21	149.58	0.12	-3.99	4.99	3.52	0.09	-5.71
	파운드(GBP/USD)	2024-10-21	1.31	-0.05	-2.21	0.92	5.68	6.56	2.52
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-10-21	0.87	-0.27	-2.02	2.84	5.43	3.02	-2.73
	호주 달러(AUD/USD)	2024-10-21	0.67	-0.18	-1.81	1.07	4.09	5.97	-1.44
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-10-19	1,368.80	-1.30	-2.58	1.08	0.31	-1.40	-5.90
	중국 위안(USD/CNY)	2024-10-19	7.10	-0.50	-0.36	2.25	1.92	3.02	-0.03
	인도 루피(USD/INR)	2024-10-18	84.07	-0.00	-0.37	-0.49	-0.63	-0.96	-1.03
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-10-18	15,465.00	0.74	-0.81	4.47	4.59	1.71	-0.44
	베트남 동(USD/VND)	2024-10-19	25,165.00	-1.39	-2.13	0.61	0.86	-2.52	-3.56
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-10-19	5.69	-1.44	-4.08	-2.61	-7.81	-11.13	-14.68
	러시아 루블(USD/RUB)	2024-10-19	95.25	0.58	-2.59	-7.19	-1.33	2.86	-6.07
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-10-19	43,275.91	0.96	2.88	7.42	13.92	30.64	14.82
	미국 NASDAQ	2024-10-19	18,489.55	0.80	3.02	4.30	20.99	42.40	23.17
	미국 S&P 500	2024-10-19	5,864.67	0.85	2.84	6.53	18.07	38.84	22.95
	일본 NIKKEI225	2024-10-18	38,981.75	-1.01	3.33	-2.70	5.16	24.70	16.49
	영국 FTSE	2024-10-19	8,358.25	1.27	1.56	2.48	5.86	12.92	8.08
	프랑스CAC40	2024-10-19	7,613.05	0.46	1.50	1.04	-5.10	11.69	0.93
	독일 DAX	2024-10-19	19,657.37	1.46	5.01	8.17	10.82	32.83	17.35
Stock - EM	한국 KOSPI	2024-10-18	2,593.82	-0.12	0.02	-7.21	0.08	9.21	-2.31
	중국 상해종합	2024-10-18	3,261.56	1.36	19.17	9.36	6.40	9.34	9.63
	인도 Sensex	2024-10-18	81,224.75	-0.19	-3.93	0.77	11.13	24.20	12.44
	인도네시아 Jakarta	2024-10-18	7,760.06	3.18	0.22	6.38	9.49	13.30	6.70
	베트남 VN index	2024-10-18	1,285.46	-0.23	1.05	1.64	9.41	16.01	13.76
	브라질 Bovespa	2024-10-19	130,499.26	0.39	-0.43	2.26	4.30	15.33	-2.75
Rates - DM	미국(10y)	2024-10-18	4.08	-1.75	37.90	-11.93	-54.98	-83.21	20.37
	독일(10y)	2024-10-18	2.18	-8.20	-0.70	-24.90	-31.40	-74.10	15.90
	영국(10y)	2024-10-18	4.06	-15.10	20.90	-0.80	-21.60	-60.10	51.90
	일본(10y)	2024-10-18	0.98	2.50	14.80	-6.50	10.80	16.80	36.30
Rates - EM	한국(10y)	2024-10-18	3.08	0.30	15.30	-5.50	-48.50	-120.50	-9.50
	인도(10y)	2024-10-18	6.82	2.70	3.80	-14.80	-36.90	-52.80	-35.50
	인도네시아(10y)	2024-10-18	6.66	-2.30	10.30	-27.20	-28.20	-22.40	18.00
	베트남(10y)	2024-10-17	2.76	2.00	-4.00	-14.00	-15.00	-26.00	39.00
	러시아(10y)	2024-06-20	15.45	45.28	136.68	228.34	359.60	442.91	358.28
	브라질(10y)	2024-10-18	12.78	24.40	72.10	77.10	119.00	94.40	241.20
Commodity	WTI	2024-10-21	69.03	-6.50	-4.02	-13.85	-16.97	-22.22	-3.66
	브렌트유	2024-10-21	72.86	-5.94	-2.19	-11.82	-16.53	-20.94	-5.43
	금	2024-10-21	2,723.27	2.82	3.60	13.63	17.01	38.04	32.01

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