

Weekly Global FX Market Monitor

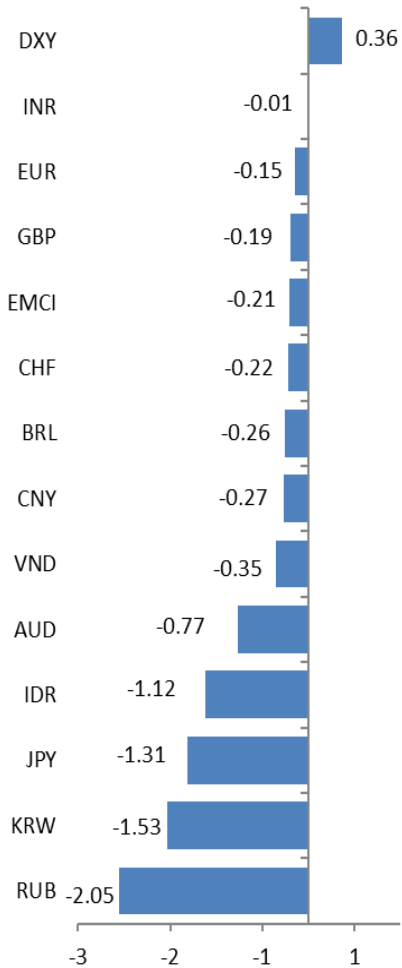
2024. 10. 28



Global

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

■ 주간변동률(%)



주 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(10/21~10/25) 글로벌 외환시장은 달러 강세(+0.36%), 유로 약세(-0.15%), 엔화 약세(-1.31%)
 - 경합주 및 베틱 업체 조사에서 트럼프가 우위를 점하면서 트럼프 트레이드 전주에도 이어졌고 미국채 금리와 달러화 상승. 달러 인덱스 104.25pt 선 마감
 - 탄탄한 미 경제에 대한 기대 이어지는 것과 대조적으로 유로 경제 지표 부진 확인되고 있고 ECB 금리 인하 등으로 유로화 하락. 프랑스 10월 PMI 예비치 부진했으나 독일 PMI는 시장 기대 상회
 - 미 대선에서 트럼프 당선 기대감이 환율에 반영되면서 엔화 환율은 한때 달러당 153엔 대까지 상승했으나 주 후반 소폭 하락하며 152엔 대 마감
- 트럼프 트레이드 이어지며 미국채 금리와 미달러 인덱스 상승했고 이에 신흥국 통화(-0.21%)는 약세 보임
 - 중국 3분기 GDP 전년동기비 4.6% 성장하며 목표치(5%) 하회했으나 생산 및 소비는 개선. 경기 부양 위한 당국 의지 반영하듯 인민은행은 5년 및 1년 LPR 각각 25bp 인하. 중국 위안(-0.27%) 약세 마감
 - 전주 인도 루피(0.01%), 베트남 동(-0.35%), 인도네시아 루피아(-1.12%)는 모두 약세 보임

미국 국채 금리와 달러 지수 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

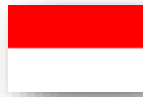
유로화와 엔화 환율 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

Weekly Global FX Market Monitor

2024. 10. 28



Indonesia

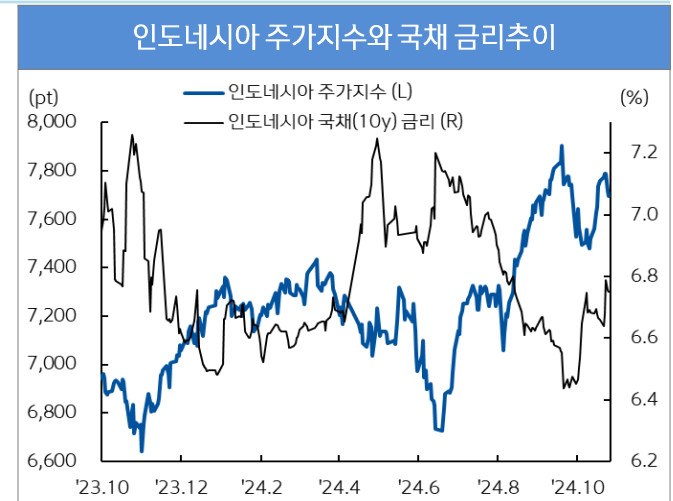
신한인도네시아은행 자금부 이상훈
021-2975-1716
sanghoonlee@shinhan.com

환율(USD/IDR)	15,640
52주최고	16,478
52주최저	15,070
주가(Jakarta index)	7,695
52주최고	7,911
52주최저	6,640
국채금리(10년물,%)	6.79
52주최고	7.25
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(10/21~10/25) USD/IDR(market rate)는 15,495~15,640(블룸버그 증가), 전주 대비 약세(-1.12%)
- 트럼프 당선 확률이 높아지면서 트럼프 트레이드 이어졌고 미 달러 강세 보임. 이에 인도네시아 루피아는 약세 보였고 인도네시아 중앙은행의 개입으로 환율 상승폭은 다소 축소
- 외국인은 지난 주 5영업일 간(10/21~10/25) 인도네시아 주식시장에서 순매도 채권시장에서 순매수 기록
 - 주식: 외국인 순매도(10/21~10/25 누적: 2억 3,077만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 하락(-0.84%)
 - 채권: 외국인 순매수(10/21~10/24 누적: 875만 달러) 기록, 금리 상승(10y, 6.79%, +15.10bp)
- 이번 주 소비자물가지수 발표 예정이며 소비심리지수 하락과 고용시장 냉각으로 둔화세 이어갈 듯. 시장은 전년비 2.08% 상승 전망
- 단기간에 진행된 미 달러 강세 금주에도 이어질 지 미지수이지만 미 대선 관련 불확실성 해소되지 않아 금주에도 루피아 강세 전환하기 어려울 듯. 이번 주 발표될 미 3분기 성장률과 고용지표, 유럽 3분기 GDP 등 확인 후 달러 강세 조정 가능성 있음 (금주 예상 레인지: 15,400~15,800)



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.10.28

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-10-28	104.39	0.36	3.99	0.07	-1.46	-2.04	3.02
	유로(EUR/USD)	2024-10-28	1.08	-0.15	-3.02	-0.20	0.73	1.73	-2.17
	엔화(USD/JPY)	2024-10-28	152.84	-1.31	-6.03	0.77	2.30	-2.45	-7.72
	파운드(GBP/USD)	2024-10-28	1.30	-0.19	-3.10	0.76	3.16	6.49	1.80
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-10-28	0.87	-0.22	-2.59	2.07	4.87	3.91	-3.08
	호주 달러(AUD/USD)	2024-10-28	0.66	-0.77	-4.41	0.90	0.62	3.67	-2.99
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-10-26	1,390.10	-1.53	-3.93	-0.50	-1.10	-2.92	-7.34
	중국 위안(USD/CNY)	2024-10-26	7.12	-0.27	-1.23	1.76	1.66	2.75	-0.30
	인도 루피(USD/INR)	2024-10-25	84.08	-0.01	-0.57	-0.45	-0.90	-1.06	-1.04
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-10-25	15,640.00	-1.12	-3.45	3.90	3.50	1.47	-1.55
	베트남 동(USD/VND)	2024-10-28	25,379.00	-0.35	-3.20	-0.35	-0.13	-3.20	-4.37
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-10-26	5.71	-0.26	-4.09	-1.11	-9.61	-12.48	-14.90
러시아 루블(USD/RUB)	2024-10-26	97.25	-2.06	-5.28	-12.59	-5.12	-3.95	-8.00	
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-10-26	42,114.40	-2.68	-0.47	3.76	10.13	29.91	11.74
	미국 NASDAQ	2024-10-26	18,518.61	0.16	2.20	6.69	16.27	46.47	23.36
	미국 S&P 500	2024-10-26	5,808.12	-0.96	1.22	6.39	13.89	41.06	21.77
	일본 NIKKEI225	2024-10-25	37,913.92	-2.74	-4.81	0.65	-0.05	22.34	13.30
	영국 FTSE	2024-10-26	8,248.84	-1.31	-0.86	-0.44	1.34	13.13	6.67
	프랑스CAC40	2024-10-26	7,497.54	-1.52	-3.78	-0.27	-7.30	10.33	-0.61
	독일 DAX	2024-10-26	19,463.59	-0.99	-0.05	5.68	7.17	32.52	16.19
Stock - EM	한국 KOSPI	2024-10-25	2,583.27	-0.41	-2.51	-5.44	-2.75	12.18	-2.71
	중국 상해종합	2024-10-25	3,299.70	1.17	6.87	14.14	6.83	9.34	10.92
	인도 Sensex	2024-10-25	79,402.29	-2.24	-7.21	-2.37	7.69	24.49	9.91
	인도네시아 Jakarta	2024-10-25	7,694.66	-0.84	-0.03	5.58	9.36	13.85	5.80
	베트남 VN index	2024-10-25	1,252.72	-2.55	-2.96	0.85	3.57	18.11	10.87
브라질 Bovespa	2024-10-26	129,893.32	-0.46	-2.14	1.88	2.66	14.64	-3.20	
Rates - DM	미국(10y)	2024-10-25	4.24	15.71	45.50	-0.08	-46.40	-71.50	36.08
	독일(10y)	2024-10-25	2.29	10.80	11.60	-12.60	-33.90	-59.80	26.70
	영국(10y)	2024-10-25	4.23	17.70	24.30	10.30	-12.90	-37.70	69.60
	일본(10y)	2024-10-25	0.96	-2.10	14.10	-10.30	5.70	9.70	34.20
Rates - EM	한국(10y)	2024-10-25	3.06	-2.00	6.30	-6.20	-65.10	-122.70	-11.50
	인도(10y)	2024-10-25	6.85	3.10	11.50	-10.20	-35.50	-49.00	-32.40
	인도네시아(10y)	2024-10-28	6.79	15.10	31.60	-19.40	-39.10	-44.20	31.00
	베트남(10y)	2024-10-25	2.80	4.00	4.00	-10.00	-14.00	-45.00	43.00
	러시아(10y)	2024-06-20	15.45	45.28	136.68	228.34	359.60	442.91	358.28
브라질(10y)	2024-10-25	12.69	-8.80	44.30	48.30	96.50	93.20	232.40	
Commodity	WTI	2024-10-28	68.60	-2.78	0.62	-11.09	-18.19	-19.80	-4.26
	브렌트유	2024-10-28	72.81	-1.99	1.15	-10.26	-18.65	-19.53	-5.49
	금	2024-10-28	2,737.08	0.63	3.89	14.80	17.19	37.12	32.68

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