

Weekly Global FX Market Monitor

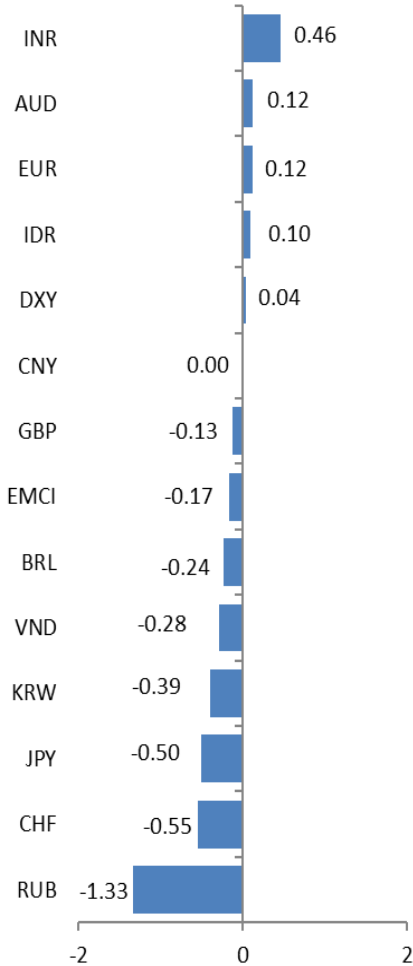
2024.2.19



Global

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

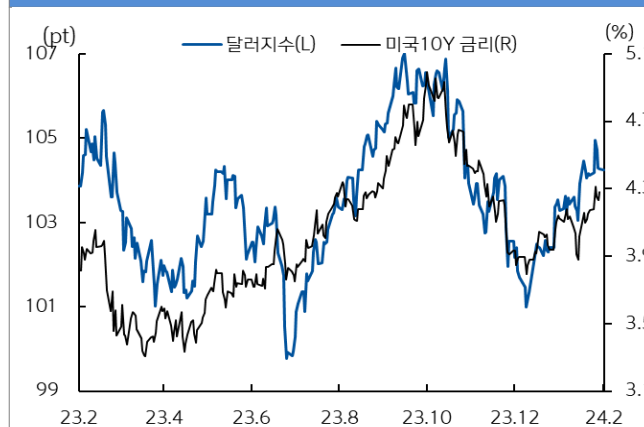
■ 주간변동률(%)



주) 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(2/12~2/16) 글로벌 외환시장은 달러 보합(+0.04%), 유로 강세(+0.12%), 엔화 약세(-0.50%)
 - 예상을 상회한 미 1월 소비자물가 확인 후 미 달러 강세 보였으나 금리 인하 기대 과도하게 반영했던 시장과 연준과의 시각차 축소되자 달러화 인덱스는 소폭 반락, 104.2포인트 선 마감
 - 유로존 경기 서프라이즈 지수가 기준선 0을 상회, 시장 예상치보다 긍정적인 지표가 많았음을 확인했으나 예상을 상회한 미 CPI로 유로화는 큰 폭으로 상승하지 못하고 1.077 달러 마감
 - 1월 미 소비자물가상승률 확인 후 미국채 금리 상승, 엔화 환율은 달러당 151엔에 육박. 일본 4분기 성장률 부진 확인했으나 엔화 환율은 하락하며 달러당 150.2엔 마감
- 전주 미 소비자물가지수 확인 후 신흥국 통화 약세 보였으나 위험 선호 심리는 유지. 신흥국 증시 호조와 함께 주중 신흥국 통화 지수 반등하였으나 주 후반 다시 소폭 하락하며 혼조세 보임
 - 러시아 중앙은행은 3월 대선 전 마지막 통화정책 회의에서 정책금리 동결(16%). 루블(-1.33%)은 약세 보임
 - 전주 인도 루피(+0.46%)는 강세, 베트남 동(-0.28%)은 약세, 인도네시아 루피아(+0.10%) 강보합 기록

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

2024.2.19



Indonesia

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

환율(USD/IDR)	15,620
52주최고	15,962
52주최저	14,575
주가(Jakarta index)	7,336
52주최고	7,404
52주최저	6,543
국채금리(10년물,%)	6.62
52주최고	7.26
52주최저	6.16
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	5.04
소비자물가(% YoY)	2.57
생산자물가(% YoY)	2.80
정책금리(%)	6.00
제조업 PMI (index)	52.9
산업생산(% YoY)	-1.89
소매판매(% YoY)	0.07
수출(% YoY)	-8.06
수입(% YoY)	0.36
경상수지(백만달러)	-900
재정수지(십억루피아)	-460,420
외환보유고(십억달러)	145

- 지난 주(2/12~2/19) USD/IDR(marketrate)는 15,595~15,620흐름(블룸버그 종가), 전주 대비강보합(+0.10%)
- 14일 치뤄진 대선에서 비공식 투표 집계 결과를 통해 프라보워 수비안토 후보가 과반을 상회하는 표를 얻은 것으로 확인되자 후보는 대선 승리를 선언. 정치적 불확실성 축소되며 전주 루피아 환율 안정된 흐름 보임
- 1월 무역수지는 20.1억 달러 흑자 기록. 광물 수출이 큰 폭으로 감소하면서 전월 수정치(32.8억 달러) 크게 하회. 1월 수출과 수입은 각각 전년비 -8.06%, +0.36% 기록
- 외국인은 지난 주 4영업일 간(2/12~2/16) 인도네시아 주식시장에서 순매수, 채권시장에서 순매도 기록
 - 주식: 외국인 순매수(2/12~2/16 누적: 4억 9,122만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 상승(+1.22%)
 - 채권: 외국인 순매도(2/13: 7,938만 달러) 기록, 금리 상승(10y, 6.62%, +0.50bp), 2/12,15~16 정보 미제공
- 금주 발표될 FOMC 의사록 확인 후 달러화 방향 움직임 수 있으나 시장과 연준의 피벗시점 인식 차 감소되고 있고 수비안토 후보의 당선이 유력해지면서 정치적 불확실성도 축소. 이에 루피아 강세 보일 수 있을 듯. 이번 주 중앙은행 통화정책 회의 예정되어 있으며 루피아 가치 안정을 위해 기준금리 6%에서 동결할 것으로 예상 (금주 예상 레인지 : 15,430~15,700)



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.2.19

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-02-19	104.24	0.06	0.92	0.31	0.83	0.36	2.87
	유로(EUR/USD)	2024-02-19	1.08	0.09	-1.06	-1.44	-1.05	0.90	-2.33
	엔화(USD/JPY)	2024-02-19	150.11	-0.51	-1.33	-1.15	-2.59	-10.57	-6.04
	파운드(GBP/USD)	2024-02-19	1.26	-0.18	-0.76	0.81	-1.18	4.69	-0.98
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-02-19	0.88	-0.59	-1.42	0.47	-0.27	4.81	-4.48
	호주 달러(AUD/USD)	2024-02-19	0.65	0.06	-0.94	-0.34	1.89	-5.40	-4.07
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-02-16	1,335.55	-0.55	-0.28	-2.89	0.09	-3.80	-3.55
	중국 위안(USD/CNY)	2024-02-09	7.19	-0.00	-0.35	1.27	0.24	-5.66	-1.30
	인도 루피(USD/INR)	2024-02-16	83.02	0.02	0.07	0.27	-0.07	-0.36	0.23
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-02-16	15,620.00	0.10	-0.19	-0.48	-2.16	-2.96	-1.43
	베트남 동(USD/VND)	2024-02-19	24,493.00	-0.28	0.23	-1.15	-2.76	-2.76	-0.91
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-02-17	4.97	-0.24	-0.79	-1.97	0.52	5.11	-2.19
	러시아 루블(USD/RUB)	2024-02-17	92.38	-1.33	-4.41	-3.37	3.48	-18.94	-3.15
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-02-17	38,627.99	-0.11	2.02	10.53	11.96	14.19	2.49
	미국 NASDAQ	2024-02-17	15,775.65	-1.34	3.03	11.68	18.70	33.84	5.09
	미국 S&P 500	2024-02-17	5,005.57	-0.42	3.42	10.89	14.55	22.71	4.94
	일본 NIKKEI225	2024-02-16	38,487.24	4.41	7.02	14.60	22.37	39.89	15.01
	영국 FTSE	2024-02-17	7,711.71	1.84	3.35	2.76	6.19	-3.66	-0.28
	프랑스CAC40	2024-02-17	7,768.18	1.58	5.38	7.39	8.43	5.72	2.98
	독일 DAX	2024-02-17	17,117.44	1.13	3.40	7.53	9.91	10.56	2.18
Stock - EM	한국 KOSPI	2024-02-16	2,648.76	1.09	7.12	7.24	5.76	8.06	-0.25
	중국 상해종합	2024-02-08	2,865.90	3.43	-0.95	-6.14	-11.67	-12.37	-3.67
	인도 Sensex	2024-02-16	72,426.64	1.16	1.04	10.08	11.51	18.73	0.26
	인도네시아 Jakarta	2024-02-16	7,335.55	1.22	1.50	5.13	6.93	6.38	0.86
	베트남 VN index	2024-02-16	1,209.70	3.17	2.39	9.85	2.69	14.20	7.06
	러시아 RTS	2024-02-17	1,107.33	-1.34	-2.01	-1.32	5.76	20.34	2.20
	브라질 Bovespa	2024-02-17	128,725.88	-0.94	0.85	3.17	11.54	17.91	-4.07
Rates - DM	미국(10y)	2024-02-16	4.28	10.38	22.11	-15.63	2.88	41.84	40.01
	독일(10y)	2024-02-16	2.40	2.00	14.40	-18.80	-24.80	-7.60	37.80
	영국(10y)	2024-02-16	4.11	2.20	31.10	-4.30	-53.80	60.90	57.10
	일본(10y)	2024-02-16	0.74	0.90	13.50	-5.60	10.50	23.00	12.10
Rates - EM	한국(10y)	2024-02-16	3.48	7.50	16.50	-31.00	-38.10	0.00	30.50
	인도(10y)	2024-02-16	7.10	-0.70	-4.80	-13.60	-10.60	-22.10	-7.50
	인도네시아(10y)	2024-02-16	6.62	0.50	-4.70	-33.00	18.60	-7.30	14.20
	베트남(10y)	2024-02-16	2.38	4.00	15.00	-17.00	-22.00	-180.00	5.00
	러시아(10y)	2024-02-16	12.17	27.07	27.70	28.01	81.64	135.63	30.76
	브라질(10y)	2024-02-16	10.85	3.40	14.20	-21.40	-28.10	-250.40	48.50
Commodity	WTI	2024-02-19	79.05	2.77	7.68	4.16	-2.71	3.55	10.33
	브렌트유	2024-02-19	83.15	1.40	5.84	3.15	-1.95	0.18	7.93
	금	2024-02-19	2,013.56	-0.32	-0.78	1.79	6.26	9.35	-2.40

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