

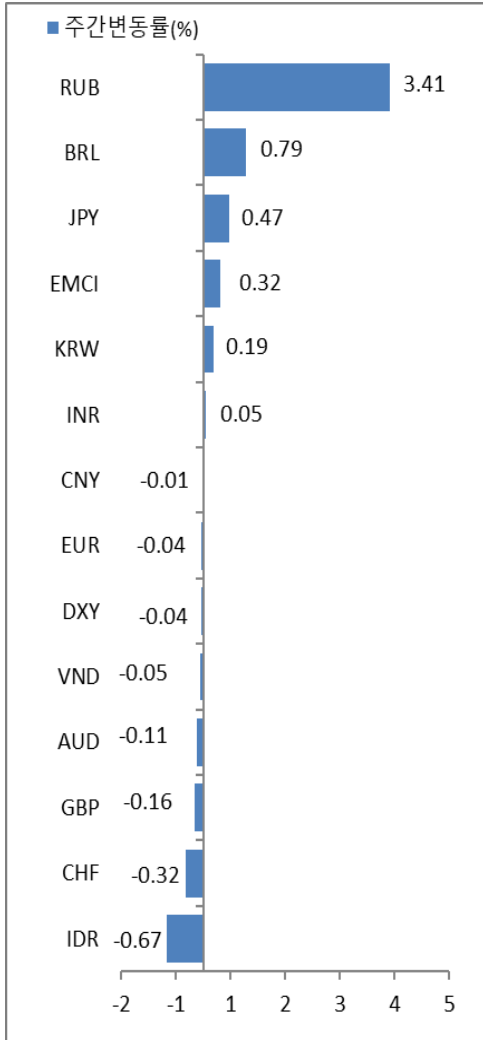
Weekly Global FX Market Monitor

2024.3.4



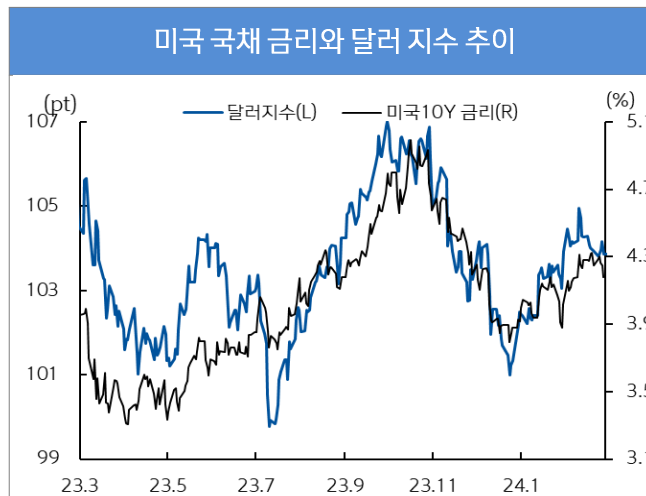
Global

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

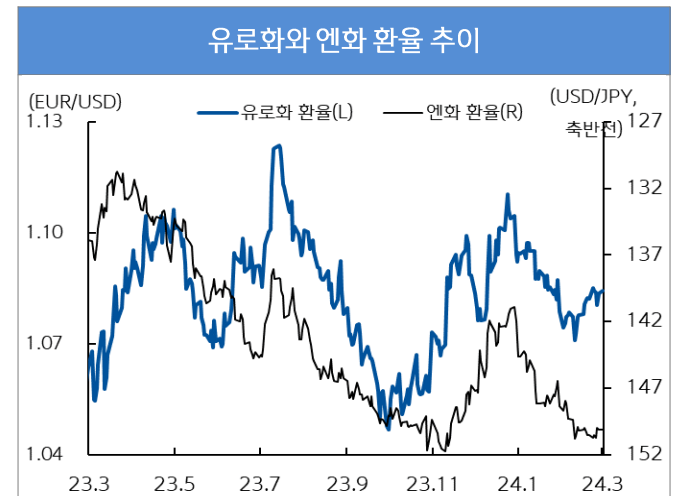


주 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(2/26~3/1) 글로벌 외환시장은 달러 보합(+0.03%), 유로 약보합(-0.06%), 엔화 강세(+0.38%)
 - 전주 큰 움직임 없었던 미 달러 인덱스는 주 후반 소폭 상승했으나 미 PCE 물가 발표 후 반락하며 103.8 포인트 대 마감
 - 유로화는 뚜렷한 방향성없이 1.08달러 대에서 움직임. ECB 라가르드 총재는 디스인플레이션 지속 예상하지만 추가적인 증거 필요하다는 의견 표출
 - 미국채 금리 상승세 진정되자 환율도 횡보했으나 주 후반 BOJ 정책 심의위원이 인플레이션 목표 달성이 가시권에 들어왔으며 통화 완화 정책 종료를 포함한 유연한 조치 검토가 필요하다 발언하자 엔화 강세 보임
- 미 PCE 데이터 대기하며 횡보했던 신흥국 통화는 예상에 부합하는 PCE 데이터 확인 후 상승 마감
 - 러시아 2월 세금납부 기간 도래하자 루블 수요 증대. 이에 금주 루블(3.41%)은 강세 보임
 - 전주 인도 루피(+0.05%)는 강세, 베트남 동(-0.05%)과 인도네시아 루피아(-0.67%)는 약세 기록



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

Weekly Global FX Market Monitor

2024.3.4



Indonesia

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

환율(USD/IDR)	15,700
52주최고	15,962
52주최저	14,575
주가(Jakarta index)	7,312
52주최고	7,404
52주최저	6,543
국채금리(10년물,%)	6.63
52주최고	7.26
52주최저	6.16
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	5.04
소비자물가(% YoY)	2.75
생산자물가(% YoY)	2.80
정책금리(%)	6.00
제조업 PMI (index)	52.7
산업생산(% YoY)	-1.04
소매판매(% YoY)	3.70
수출(% YoY)	-8.2
수입(% YoY)	0.28
경상수지(백만달러)	-1,290
재정수지(십억루피아)	-460,420
외환보유고(십억달러)	145

- 지난 주(2/26~3/1) USD/IDR(market rate)는 15,630~15,715흐름(블룸버그 증가), 전주 대비 약세(-0.67%)
- 미 PCE 데이터 발표 대기하며 전주 글로벌 주식시장은 혼조세 보였으며 인도네시아 주식시장에서 글로벌 자금 유출, 이에 인도네시아 루피아는 약세 보임
- 2월 소비자물가지수는 전년비 2.75% 상승. 이상기후와 홍해지역 물류 대란으로 식품가격 상승하면서 2월 물가상승률은 이전치(2.57%)와 예상치(2.60%) 모두 상회
- 외국인은 지난 주 5영업일 간(2/26~3/1) 인도네시아 주식시장에서 순매도, 채권시장에서 순매수 기록
 - 주식: 외국인 순매도(2/26~3/1 누적: 1억 9,317만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 상승(+1.40%)
 - 채권: 외국인 순매수(2/26~2/29 누적: 6,382만 달러) 기록, 금리 상승(10y, 6.63%, +5.70bp)
- 예상에 부합했던 PCE 가격지수와 예상치를 하회한 ISM 제조업 지수 확인한 시장은 위험자산투자심리 이어갈 수 있을 것으로 보이며 이에 루피아 강세보일 수 있을 듯. 다만 금주 미국 임시 예산안 시한 만료 및 비농업고용지표 발표 예정되어 있어 시장 심리 변동될 수 있음 (금주 예상 레인지 : 15,450~15,760)

인도네시아 루피아 환율과 달러지수 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

인도네시아 주가지수와 국채 금리추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.3.4

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-03-04	103.86	0.03	-0.06	0.14	-0.36	-0.63	2.49
	유로(EUR/USD)	2024-03-04	1.08	-0.06	0.94	0.07	0.44	1.53	-1.77
	엔화(USD/JPY)	2024-03-04	150.13	0.38	-0.97	-1.95	-2.44	-9.46	-6.05
	파운드(GBP/USD)	2024-03-04	1.27	-0.19	1.00	0.22	0.29	5.29	-0.55
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-03-04	0.88	-0.37	-1.43	-1.19	0.15	5.37	-4.74
	호주 달러(AUD/USD)	2024-03-04	0.65	-0.18	0.69	-1.39	1.04	-3.00	-4.17
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-02-29	1,331.40	-0.20	0.24	-3.10	-0.66	-0.63	-3.25
	중국 위안(USD/CNY)	2024-03-02	7.20	-0.01	-0.23	-0.95	0.97	-4.54	-1.35
	인도 루피(USD/INR)	2024-03-01	82.91	0.05	0.09	0.47	-0.22	-0.48	0.37
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-03-01	15,700.00	0.00	0.41	-1.37	-2.93	-2.96	-1.93
	베트남 동(USD/VND)	2024-03-04	24,649.00	-0.05	-1.08	-1.61	-2.31	-3.85	-1.54
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-03-02	4.96	0.79	-0.85	-1.46	-0.11	4.55	-1.97
러시아 루블(USD/RUB)	2024-03-02	91.73	3.41	-1.51	-0.77	5.01	-18.12	-2.47	
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-03-02	39,087.38	-0.11	1.12	7.96	12.20	17.06	3.71
	미국 NASDAQ	2024-03-02	16,274.94	1.74	4.13	14.73	15.99	39.23	8.42
	미국 S&P 500	2024-03-02	5,137.08	0.95	3.60	12.41	13.76	26.98	7.70
	일본 NIKKEI225	2024-03-01	39,910.82	2.08	10.38	20.10	21.17	42.91	19.26
	영국 FTSE	2024-03-02	7,682.50	-0.31	0.88	2.26	3.08	-3.33	-0.66
	프랑스CAC40	2024-03-02	7,934.17	-0.41	4.50	8.20	8.99	7.98	5.18
	독일 DAX	2024-03-02	17,735.07	1.81	4.83	8.11	12.07	13.84	5.87
Stock - EM	한국 KOSPI	2024-02-29	2,642.36	-0.82	3.93	5.48	3.07	9.51	-0.49
	중국 상해종합	2024-03-01	3,027.02	0.74	10.87	0.14	-4.72	-9.05	1.75
	인도 Sensex	2024-03-02	73,806.15	1.40	2.39	7.17	12.46	23.40	2.17
	인도네시아 Jakarta	2024-03-01	7,311.91	0.23	1.01	3.08	4.50	7.31	0.54
	베트남 VN index	2024-03-01	1,258.28	3.82	7.31	12.30	2.80	22.79	11.36
	러시아 RTS	2024-03-02	1,122.32	5.44	0.45	4.21	5.54	18.71	3.58
브라질 Bovespa	2024-03-02	129,180.37	-0.18	1.57	1.88	9.68	24.37	-3.73	
Rates - DM	미국(10y)	2024-03-01	4.18	-6.82	29.96	-1.58	0.10	18.73	30.07
	독일(10y)	2024-03-01	2.41	5.10	26.50	5.20	-13.50	-29.70	39.00
	영국(10y)	2024-03-01	4.11	7.70	36.80	-2.60	-31.40	27.60	57.70
	일본(10y)	2024-03-01	0.72	-0.30	1.20	2.00	8.40	21.10	10.30
Rates - EM	한국(10y)	2024-02-29	3.48	5.00	3.90	-16.00	-36.50	-28.00	30.50
	인도(10y)	2024-03-01	7.06	-1.90	-0.10	-23.30	-11.00	-33.70	-11.70
	인도네시아(10y)	2024-03-01	6.63	5.70	8.40	0.80	23.90	-23.50	14.70
	베트남(10y)	2024-03-01	2.45	-5.00	0.00	0.00	-20.00	-210.00	5.00
	러시아(10y)	2024-03-01	12.30	9.43	58.75	41.03	82.33	147.70	43.04
브라질(10y)	2024-03-01	10.81	-8.20	20.20	-8.20	-28.60	-269.40	44.20	
Commodity	WTI	2024-03-04	79.97	3.08	10.64	9.49	-6.52	0.36	11.61
	브렌트유	2024-03-04	83.61	1.31	8.12	7.15	-6.06	-2.59	8.53
	금	2024-03-04	2,086.08	2.70	3.01	2.79	7.38	12.95	1.12

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