

Weekly Global FX Market Monitor

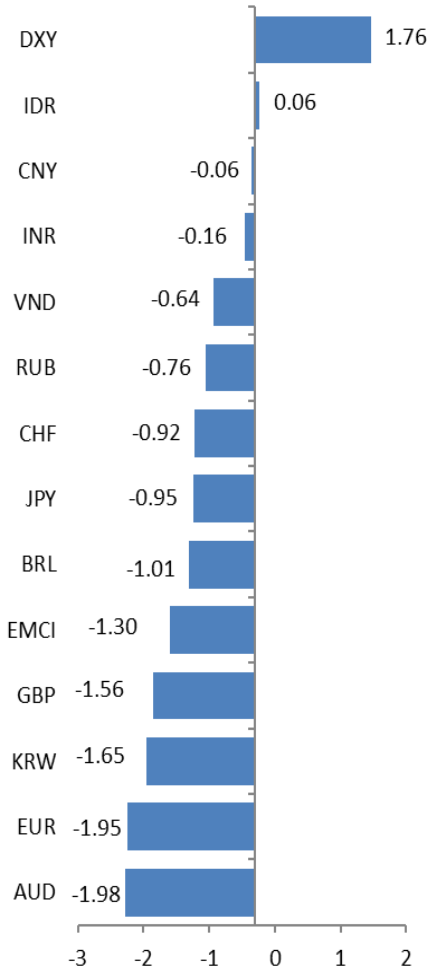
2024. 4. 16.



Global

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

■ 주간변동률(%)



주 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(4/8~4/12) 글로벌 외환시장은 달러 강세(+1.76%), 유로 약세(-1.95%), 엔화 약세(-0.95%)
 - 시장 예상치를 상회한 3월 소비자물가지수 확인 후 연준의 6월 금리 인하에 대한 기대감 약화되며 달러화 강세. 생산자물가 상승률은 양호했으나 중동 확전 우려로 안전 선호 심리 확대되면서 달러인덱스 106pt 선 마감
 - 미 소비자물가 상승률 확인 후 연준의 연내 금리 인하 횟수 2회 이하로 줄어들 가능성이 높아졌고 유럽 중앙은행이 4월 통화정책회의에서 6월 금리 인하 시사하면서 유로화는 1.06달러 대까지 하락
 - 미 연준의 6월 금리 인하 기대감 약화되며 미국채 금리 상승했고 미 달러화도 강세 보임. 이에 엔화는 약세 보였고 달러당 153엔 대까지 상승
- 미 CPI 여파로 미국채 금리 상승하고 미 달러 강세 보이자 신흥국 통화는 약세 보임. 주 후반 이란의 이스라엘 보복 가능성이 거론되면서 안전자산 선호 심리 확산되자 신흥국 통화지수 추가 하락
 - 금주 발표될 예산 지침에 따른 재정 리스크 확대 우려 및 국영 에너지 회사인 페트로브라스의 배당금 이슈로 브라질 헤알(-1.01%)은 전주 약세 보임
 - 전주 인도 루피(-0.16%)와 베트남 동(-0.64%) 약세 기록, 인도네시아 금융시장 르바란 휴일로 휴장

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. 4. 16.



Indonesia

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

환율(USD/IDR)	16,184
52주최고	16,190
52주최저	14,575
주가(Jakarta index)	7,153
52주최고	7,454
52주최저	6,563
국채금리(10년물,%)	6.85
52주최고	7.26
52주최저	6.16
주요 경제 지표 Snap shot	
실질GDP성장률(% YoY)	5.04
소비자물가(% YoY)	3.05
생산자물가(% YoY)	3.64
정책금리(%)	6.00
제조업 PMI (index)	54.2
산업생산(% YoY)	-1.04
소매판매(% YoY)	3.60
수출(% YoY)	-9.45
수입(% YoY)	15.84
경상수지(백만달러)	-1,290
재정수지(십억루피아)	-460,420
외환보유고(십억달러)	140

- 지난 주(4/8~4/15) 르바란 휴일로 외환시장 휴장. 금일(4/16) USD/IDR(market rate) 15,976으로 장 시작
- 전주 예상을 상회한 3월 미 CPI 결과 확인 후 미 연준의 6월 금리 인하 가능성 축소되면서 미 달러 강세 보였고 주 후반 이란의 이스라엘 공습이 임박했다는 주요 언론 보도로 안전자산 선호 확대. 이에, 미 달러 추가적으로 강세 보였고 신흥국 통화 약세 보임
- 15일 발표된 3월 미국 소매판매마져 전월비 0.7%증가하며 시장 예상치(0.3%) 상회하자 미 1분기 GDP 전망 상향 조정. 여전히 강한 미 경기와 중동 확전 우려에 루피아는 현재 달러당 16,184 루피아까지 상승
- 인도네시아 르바란 휴일로 주식 및 채권 시장 휴장
- 여전히 강한 미국 소비로 인한 연준의 연내 금리인하 기대 헛수 축소 및 중동사태로 인한 불확실성 확대로 신흥국 통화 약세 보일 것으로 예상되며 이에 인도네시아 루피아도 약세 보일 듯. 급격한 환율 상승 시, 중앙은행 개입할 수 있으나 중동발 불확실성 완화 전까지 시장의 과잉반응 지속될 듯 (금주 예상 레인지: 15,890~16,260)



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024. 4. 15.

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-04-15	105.97	1.76	2.45	3.48	-0.63	4.35	4.58
	유로(EUR/USD)	2024-04-15	1.06	-1.95	-2.22	-2.77	0.82	-2.55	-3.55
	엔화(USD/JPY)	2024-04-15	153.27	-0.95	-2.76	-4.92	-2.45	-12.27	-7.98
	파운드(GBP/USD)	2024-04-15	1.25	-1.56	-2.18	-2.11	1.97	0.66	-2.14
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-04-15	0.91	-0.92	-3.28	-6.35	-1.51	-1.65	-7.92
	호주 달러(AUD/USD)	2024-04-15	0.65	-1.98	-1.33	-2.81	2.07	-3.40	-4.98
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-04-12	1,375.40	-1.65	-4.69	-4.48	-2.68	-3.62	-6.35
	중국 위안(USD/CNY)	2024-04-13	7.24	-0.06	-0.76	-0.96	0.95	-5.03	-1.90
	인도 루피(USD/INR)	2024-04-12	83.42	-0.16	-0.78	-0.60	-0.21	-1.60	-0.25
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-04-05	15,845.00	0.06	-0.48	-2.08	-1.45	-5.81	-2.83
	베트남 동(USD/VND)	2024-04-13	25,031.00	-0.64	-1.55	-2.10	-2.32	-6.32	-3.04
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-04-13	5.12	-1.01	-2.86	-5.15	-1.32	-3.89	-5.10
러시아 루블(USD/RUB)	2024-04-13	93.30	-0.76	-1.66	-5.27	4.75	-11.84	-4.10	
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-04-13	37,983.24	-2.37	-1.89	1.04	12.81	12.09	0.78
	미국 NASDAQ	2024-04-13	16,175.09	-0.45	1.26	8.03	20.64	33.42	7.75
	미국 S&P 500	2024-04-13	5,123.41	-1.56	0.12	7.10	18.38	23.82	7.41
	일본 NIKKEI225	2024-04-12	39,523.55	1.36	2.11	10.09	22.30	38.71	18.11
	영국 FTSE	2024-04-13	7,995.58	1.07	3.47	5.28	5.21	1.57	3.39
	프랑스CAC40	2024-04-13	8,010.83	-0.63	-1.88	8.08	14.38	6.53	6.20
	독일 DAX	2024-04-13	17,930.32	-1.35	-0.04	7.87	18.07	13.43	7.04
Stock - EM	한국 KOSPI	2024-04-12	2,681.82	-2.19	0.56	6.17	9.19	4.29	1.00
	중국 상해종합	2024-04-12	3,019.47	-1.62	-1.15	4.61	-2.22	-9.55	1.50
	인도 Sensex	2024-04-12	74,244.90	0.02	2.20	1.25	12.01	22.86	2.77
	인도네시아 Jakarta	2024-04-05	7,286.88	-0.03	-1.29	0.05	5.78	7.27	0.19
	베트남 VN index	2024-04-12	1,276.60	1.71	1.01	10.61	10.55	21.25	12.98
	러시아 RTS	2024-04-13	1,165.53	0.83	4.10	1.77	12.71	18.58	7.57
브라질 Bovespa	2024-04-13	125,946.09	-0.67	-0.63	-4.24	8.80	18.50	-6.14	
Rates - DM	미국(10y)	2024-04-12	4.52	12.00	37.09	58.26	-17.53	113.10	64.25
	독일(10y)	2024-04-12	2.36	-4.00	2.90	17.50	-42.70	-1.10	33.50
	영국(10y)	2024-04-12	4.14	6.80	19.10	34.40	-28.60	56.70	60.00
	일본(10y)	2024-04-12	0.86	6.60	8.50	24.80	9.70	38.60	24.10
Rates - EM	한국(10y)	2024-04-12	3.54	10.20	20.40	23.20	-55.50	26.50	36.20
	인도(10y)	2024-04-12	7.18	5.70	15.20	0.00	-12.00	-1.00	0.50
	인도네시아(10y)	2024-04-05	6.65	-3.90	0.30	-5.30	-38.60	-4.30	17.40
	베트남(10y)	2024-04-12	2.85	-8.00	25.00	53.00	-17.00	-59.00	48.00
	러시아(10y)	2024-04-12	13.57	8.86	82.16	141.62	153.48	258.93	170.02
	브라질(10y)	2024-04-12	11.49	12.70	69.90	96.60	-20.60	-98.90	112.30
Commodity	WTI	2024-04-15	85.50	-1.08	5.50	17.64	-2.50	3.61	19.33
	브렌트유	2024-04-15	90.38	0.00	5.91	15.65	-0.56	4.72	17.32
	금	2024-04-15	2,358.40	0.83	9.39	14.68	22.82	18.20	14.32

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