

Weekly Global FX Market Monitor

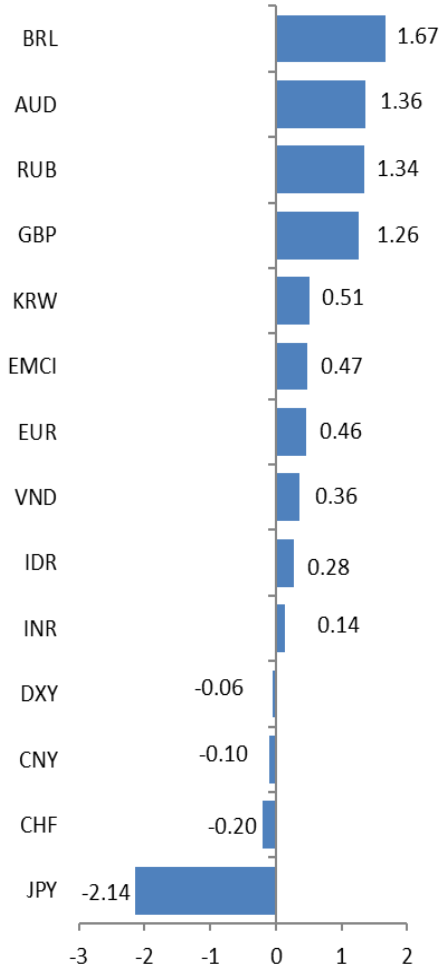
2024. 4. 29.



Global

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

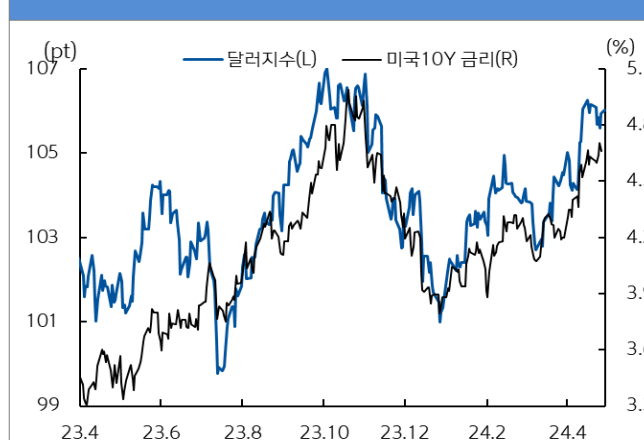
■ 주간변동률(%)



주 달러 대비 절상(+)/절하(-)를 의미

- 지난 주(4/22~4/26) 글로벌 외환시장은 달러 약세(-0.06%), 유로 강세(+0.46%), 엔화 약세(-2.14%)
 - 미국 제조업 및 서비스업 PMI 수치와 1분기 GDP 모두 시장 예상치 하회했고 중동지역 긴장감 완화되고 있으나 미 연준의 경계감에 달러화 하방 압력 지지되며 달러 인덱스 105pt 후반대 마감
 - 유로존 4월 제조업 PMI 45.6으로 부진했으나 서비스업 PMI(52.9)는 이전치(51.5) 상회하며 확장 국면 지속. 유로화는 1.069달러 마감
 - 일본 외환 당국의 개입 경계감에 상승세 저지되었던 엔화 환율은 중앙은행의 정책 동결 결정 후에 달러엔 환율은 158엔 상회하며 34년 만에 최고치 경신
- 미국 PCE 가격 지표를 통해 기저 인플레이션 압력 확인했으나 중동지역 긴장감 다소 완화되었고 미 1분기 GDP와 4월 제조업 PMI 둔화하자 과도했던 시장 반응 일부 되돌려지며 신흥국통화지수 상승
 - 중국 당국이 고시 환율을 통해 역내 환율을 사실상 고정환율로 만든 가운데, 중국 경제 지표 개선 조짐에 위안 (-0.10%) 약세는 다소 완화
 - 전주 인도 루피(+0.14%), 베트남 동(+0.36%), 인도네시아 루피아(+0.28%) 모두 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. 4. 29.



Indonesia

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

환율(USD/IDR)	16,210
52주최고	16,288
52주최저	14,575
주가(Jakarta index)	7,036
52주최고	7,454
52주최저	6,563
국채금리(10년물,%)	7.18
52주최고	7.26
52주최저	6.16

주요 경제 지표 Snap shot

실질GDP성장률(% YoY)	5.04
소비자물가(% YoY)	3.05
생산자물가(% YoY)	3.64
정책금리(%)	6.25
제조업 PMI (index)	54.2
산업생산(% YoY)	-1.04
소매판매(% YoY)	3.48
수출(% YoY)	-4.19
수입(% YoY)	-12.76
경상수지(백만달러)	-1,290
재정수지(십억루피아)	-460,420
외환보유고(십억달러)	140

- 지난 주(4/22~4/26) USD/IDR(market rate)는 16,154~16,235(블룸버그 종가), 전주 대비 강세(+0.28%)
- 루피아는 중동지역 긴장감 완화 중앙은행 통화정책 대기하며 주초 강세 보였으나 주 후반 미국의 고금리 장기화 우려에 인도네시아 루피아 환율은 소폭 상승
- 인도네시아 중앙은행은 시장 글로벌 불확실성으로 인한 위험프리미엄 상승 및 미국채 수익률 상승으로 루피아 약세 보이자 기준금리 25bp 인상
- 외국인은 지난 주 5영업일 간(4/22~4/26) 인도네시아 주식시장과 채권시장에서 순매도 기록
 - 주식: 외국인 순매도(4/22~4/26 누적: 2억 7,734만 달러) 기록, 자카르타 주가지수 하락(-0.72%)
 - 채권: 외국인 순매도(4/22~4/25 누적: 3억 4만 달러) 기록, 금리 상승(10y, 7.18%, +14.10bp)
- 루피아 약세 심화되자 중앙은행은 기준금리 인상으로 대응하였으나 그 효과 미미하였음. 루피아 약세는 대외적 불확실성에서 기인한 만큼 외부의 부정적 상황 해소되기 전까지 루피아 환율 16,000선 위에서 형성될 것으로 예상. 금주 FOMC 예정되어 있으며 파월의 발언에 따라 루피아 환율 향방 정해질 듯. 4월 인도네시아 CPI 발표 예정이며 시장은 전년비 3.06% 상승할 것으로 예상 (금주 예상 레인지: 15,940~16,300)

인도네시아 루피아 환율과 달러지수 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

인도네시아 주가지수와 국채 금리 추이



자료 : Bloomberg, 신한은행 S&T센터

글로벌 주요 가격 변수 동향

2024.4.29.

분류	명칭	기준일	가격	-1주(%)	-1개월(%)	-3개월(%)	-6개월(%)	-1년(%)	YTD(%)
FX - DM	달러인덱스(DXY)	2024-04-29	106.02	-0.05	1.41	2.33	-0.50	4.29	4.63
	유로(EUR/USD)	2024-04-29	1.07	0.47	-0.79	-1.18	0.85	-2.47	-3.03
	엔화(USD/JPY)	2024-04-29	158.20	-2.12	-4.33	-6.76	-5.75	-13.08	-10.85
	파운드(GBP/USD)	2024-04-29	1.25	1.25	-0.94	-1.61	2.74	0.06	-1.78
	스위스프랑(USD/CHF)	2024-04-29	0.91	-0.19	-1.35	-5.73	-1.28	-1.99	-7.91
	호주 달러(AUD/USD)	2024-04-29	0.65	1.36	0.26	-1.10	2.57	-1.39	-4.02
FX - EM	한국 원(USD/KRW)	2024-04-26	1,375.30	0.51	-2.60	-2.84	-1.12	-2.82	-6.34
	중국 위안(USD/CNY)	2024-04-27	7.25	-0.10	-0.41	-0.95	0.97	-4.39	-2.02
	인도 루피(USD/INR)	2024-04-26	83.35	0.14	-0.07	-0.28	-0.14	-1.90	-0.17
	인도네시아 루피아(USD/IDR)	2024-04-26	16,210.00	0.28	-2.59	-2.41	-1.79	-8.49	-5.02
	베트남 동(USD/VND)	2024-04-26	25,339.00	0.36	-2.23	-2.90	-2.93	-7.34	-4.22
	브라질 헤알(USD/BRL)	2024-04-27	5.12	1.67	-2.64	-4.02	-2.52	-1.39	-5.07
	러시아 루블(USD/RUB)	2024-04-27	91.88	1.34	0.65	-2.19	1.95	-10.67	-2.62
Stock - DM	미국 Dow Jones	2024-04-27	38,239.66	0.67	-3.94	-0.24	17.96	12.15	1.46
	미국 NASDAQ	2024-04-27	15,927.90	4.23	-2.76	1.92	25.98	30.27	6.11
	미국 S&P 500	2024-04-27	5,099.96	2.67	-2.94	3.49	23.86	22.32	6.92
	일본 NIKKEI225	2024-04-26	37,934.76	2.34	-6.03	5.30	22.40	31.46	13.36
	영국 FTSE	2024-04-27	8,139.83	3.09	2.35	6.64	11.64	3.42	5.26
	프랑스CAC40	2024-04-27	8,088.24	0.82	-1.43	5.86	19.03	7.97	7.23
	독일 DAX	2024-04-27	18,161.01	2.39	-1.79	7.20	23.65	14.06	8.41
	Stock - EM	한국 KOSPI	2024-04-26	2,656.33	2.49	-3.29	6.23	15.35	6.19
중국 상해종합		2024-04-26	3,088.64	0.76	1.56	7.12	2.35	-7.06	3.82
인도 Sensex		2024-04-26	73,730.16	0.88	0.11	2.49	15.60	20.65	2.06
인도네시아 Jakarta		2024-04-26	7,036.08	-0.72	-3.47	-1.69	4.10	1.74	-3.25
베트남 VN index		2024-04-26	1,209.52	2.95	-5.81	2.88	14.04	15.29	7.04
러시아 RTS		2024-04-27	1,186.79	1.07	4.39	5.47	9.98	14.82	9.54
브라질 Bovespa		2024-04-27	126,526.27	1.12	-1.23	-1.54	11.67	21.16	-5.71
Rates - DM	미국(10y)	2024-04-26	4.66	4.23	43.14	52.57	-18.15	121.45	78.39
	독일(10y)	2024-04-26	2.58	7.50	22.50	27.60	-28.60	17.80	55.10
	영국(10y)	2024-04-26	4.32	9.40	35.30	36.00	-27.30	59.50	78.70
	일본(10y)	2024-04-26	0.89	4.00	15.20	17.40	1.60	42.60	27.70
Rates - EM	한국(10y)	2024-04-26	3.69	9.50	27.30	29.80	-71.50	37.50	51.00
	인도(10y)	2024-04-26	7.19	-4.10	9.70	1.10	-18.00	7.40	1.30
	인도네시아(10y)	2024-04-26	7.18	14.10	48.80	53.70	-1.50	65.70	70.10
	베트남(10y)	2024-04-26	2.93	2.00	26.00	56.00	-32.00	-46.00	56.00
	러시아(10y)	2024-04-29	13.61	23.46	34.59	194.36	136.27	268.34	174.55
Commodity	WTI	2024-04-29	83.47	0.75	0.36	8.71	-2.42	8.71	16.50
	브렌트유	2024-04-29	89.02	2.32	1.76	8.03	-1.61	11.92	15.55
	금	2024-04-29	2,335.22	0.34	4.72	14.85	16.99	17.79	13.20

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