

# 금리 및 환율 동향

(2024. 7. 26. - 2024. 8. 1.)

(운용전략팀)한국은행

		22년말	23년말	4월말	5월말	6월말	전주말	7/26	7/29	7/30	7/31	8/1	전일비 <sup>6)</sup>	전주말비 <sup>6)</sup>	전월말비 <sup>6)</sup>	전년말비 <sup>6)</sup>
미 국	Fed Funds <sup>1)</sup>	4.33	5.33	5.33	5.33	5.33	5.33	5.33	5.33	5.33	5.33	-	0	0	0	0
	C/D(3M)	4.58	5.35	5.38	5.39	5.39	5.31	5.31	5.28	5.28	5.29	5.28	-1	-3	-11	-7
	T/B(3M)	4.34	5.33	5.39	5.40	5.35	5.29	5.29	5.28	5.28	5.28	5.25	-3	-4	-10	-8
	T/B(6M)	4.75	5.25	5.39	5.38	5.32	5.14	5.14	5.14	5.11	5.09	5.01	-7	-13	-31	-23
	T/N(2Y)	4.43	4.25	5.04	4.87	4.75	4.38	4.38	4.40	4.36	4.26	4.15	-11	-24	-61	-10
	T/N(5Y)	4.00	3.85	4.72	4.51	4.38	4.07	4.07	4.07	4.03	3.91	3.83	-8	-24	-54	-1
	T/N(10Y)	3.87	3.88	4.68	4.50	4.40	4.19	4.19	4.17	4.14	4.03	3.98	-5	-22	-42	10
	T/B(30Y)	3.96	4.03	4.78	4.65	4.56	4.45	4.45	4.42	4.39	4.30	4.28	-3	-18	-28	25
내 국	G/B(2Y)	2.76	2.40	3.03	3.10	2.83	2.62	2.62	2.59	2.55	2.53	2.45	-8	-17	-38	5
	G/B(5Y)	2.58	1.95	2.62	2.71	2.48	2.33	2.33	2.29	2.26	2.23	2.16	-7	-17	-32	22
	G/B(10Y)	2.57	2.02	2.58	2.66	2.50	2.41	2.41	2.36	2.34	2.30	2.24	-6	-16	-26	22
영 국	G/B(2Y)	3.58	3.98	4.51	4.41	4.22	3.92	3.92	3.88	3.88	3.83	3.72	-11	-20	-50	-26
	G/B(5Y)	3.62	3.46	4.25	4.21	4.02	3.90	3.90	3.86	3.85	3.77	3.67	-10	-23	-36	20
	G/B(10Y)	3.67	3.54	4.35	4.32	4.17	4.10	4.10	4.05	4.04	3.97	3.88	-9	-22	-29	35
	G/B(30Y)	3.96	4.14	4.79	4.76	4.66	4.66	4.66	4.62	4.60	4.54	4.48	-6	-18	-18	34
일 국	G/B(2Y)	0.04	0.05	0.29	0.41	0.37	0.40	0.40	0.40	0.38	0.46	0.47	2	7	11	42
	G/B(5Y)	0.23	0.21	0.48	0.65	0.59	0.64	0.64	0.60	0.59	0.67	0.66	-1	2	7	45
	G/B(10Y)	0.42	0.61	0.88	1.07	1.06	1.07	1.07	1.03	1.00	1.06	1.04	-2	-3	-2	43
캐 나 다	G/B(2Y)	4.05	3.89	4.35	4.18	4.00	3.60	3.60	3.58	3.50	3.45	3.36	-9	-24	-63	-53
	G/B(5Y)	3.41	3.18	3.87	3.68	3.51	3.24	3.24	3.22	3.16	3.09	3.02	-6	-22	-49	-15
	G/B(10Y)	3.30	3.11	3.82	3.63	3.50	3.32	3.32	3.29	3.23	3.16	3.11	-5	-21	-40	0
호 주	G/B(2Y)	3.40	3.71	4.10	4.12	4.16	4.10	4.10	4.09	4.10	3.88	3.86	-2	-25	-31	15
	G/B(5Y)	3.68	3.64	4.10	4.10	4.07	3.99	3.99	3.98	3.99	3.78	3.75	-2	-24	-32	12
	G/B(10Y)	4.05	3.96	4.42	4.41	4.31	4.31	4.31	4.28	4.28	4.12	4.09	-3	-22	-22	13
스 위 스	G/B(2Y)	1.27	1.11	0.94	1.14	0.80	0.70	0.70	0.68	0.68	0.66	0.66	0	-4	-14	-45
	G/B(5Y)	1.47	0.80	0.82	1.04	0.67	0.58	0.58	0.59	0.57	0.53	0.53	0	-5	-14	-27
	G/B(10Y)	1.62	0.70	0.77	0.93	0.60	0.53	0.53	0.52	0.49	0.45	0.45	0	-8	-15	-25
중 국	G/B(3Y)	2.40	2.29	1.98	1.94	1.80	1.75	1.75	1.74	1.72	1.71	1.68	-2	-6	-11	-61
	G/B(5Y)	2.64	2.40	2.15	2.09	1.98	1.90	1.90	1.89	1.88	1.85	1.83	-2	-7	-15	-57
	G/B(10Y)	2.84	2.56	2.30	2.29	2.21	2.19	2.19	2.16	2.15	2.15	2.13	-2	-6	-8	-43
환 율 <sup>2)</sup>	DXY	103.52	101.33	106.22	104.67	105.87	104.32	104.32	104.56	104.55	104.10	104.42	0.31	0.10	-1.36	3.05
	EURUSD	1.0705	1.1039	1.0666	1.0848	1.0713	1.0856	1.0856	1.0821	1.0815	1.0826	1.0791	-0.32	-0.60	0.73	-2.25
	USDJPY	131.12	141.04	157.80	157.31	160.88	153.76	153.76	154.02	152.77	149.98	149.36	0.42	2.95	7.71	-5.57
	GBPUSD	1.2083	1.2731	1.2492	1.2742	1.2645	1.2867	1.2867	1.2862	1.2836	1.2856	1.2739	-0.91	-0.99	0.74	0.06
	USDCAD	1.3554	1.3243	1.3778	1.3628	1.3679	1.3836	1.3836	1.3853	1.3849	1.3808	1.3874	-0.48	-0.27	-1.41	-4.55
	AUDUSD	0.6813	0.6812	0.6473	0.6653	0.6670	0.6548	0.6548	0.6549	0.6538	0.6542	0.6501	-0.63	-0.72	-2.53	-4.57
	USDCHF	0.9245	0.8414	0.9194	0.9023	0.8988	0.8836	0.8836	0.8861	0.8827	0.8780	0.8730	0.57	1.21	2.96	-3.62
	USDCNY	6.8986	7.1000	7.2411	7.2418	7.2673	7.2505	7.2505	7.2603	7.2410	7.2267	7.2450	-0.25	0.08	0.31	-2.00
	SDRUSD	1.3308	1.3447	1.3179	1.3235	1.3153	1.3265	1.3265	1.3258	1.3254	1.3284	1.3257	0.21	0.06	-0.78	1.44
	EURJPY	140.36	155.69	168.31	170.65	172.35	166.92	166.92	166.67	165.22	162.37	161.17	0.74	3.57	6.93	-3.40
L I B O R <sup>3)</sup>	USD(3M)	4.7673	5.5930	5.5898	5.6045	5.5862	5.5170	5.5170	5.5137	5.5093	5.5027	-	-0.66	-1.43	-8.35	-9.03
	USD(6M)	5.1389	5.5860	5.7398	5.7425	5.6830	5.5197	5.5197	5.5160	5.5075	5.5038	-	-0.36	-1.59	-17.91	-8.21
	Euribor(3M) <sup>4)</sup>	2.1320	3.9090	3.8250	3.7850	3.7110	3.6550	3.6550	3.6360	3.6310	3.6470	-	1.60	-0.80	-6.40	-26.20
	JPY(3M)	-0.0262	-0.0070	0.0380	0.0649	0.0844	0.0846	0.0846	0.0846	0.0847	0.0847	0.0847	0.00	0.01	0.03	9.17
	GBP(3M)	3.8740	5.3246	5.3434	5.3475	5.3513	5.3524	5.3524	5.3524	5.3524	5.3524	5.3524	0.00	0.00	0.11	2.78
주 가	미국(DJIA)	33,147	37,690	37,816	38,686	39,119	40,589	40,589	40,540	40,743	40,843	40,348	-1.21	-0.59	3.14	7.05
	미국(Nasdaq)	10,466	15,011	15,658	16,735	17,733	17,358	17,358	17,370	17,147	17,599	17,194	-2.30	-0.94	-3.04	14.54
	독일(DAX)	13,924	16,752	17,932	18,498	18,235	18,418	18,418	18,321	18,411	18,509	18,083	-2.30	-1.82	-0.84	7.95
	일본(Nikkei)	26,095	33,464	38,406	38,488	39,583	37,667	37,667	38,469	38,526	39,102	38,126	-2.49	1.22	-3.68	13.93
	중국(Shanghai)	3,089	2,975	3,105	3,087	2,967	2,891	2,891	2,892	2,879	2,939	2,932	-0.22	1.44	-1.18	-1.43
상 품	유가(WTI) <sup>5)</sup>	80.3	71.7	81.9	77.0	81.5	77.2	77.2	75.8	74.7	77.9	76.3	-2.05	-1.10	-6.41	6.50
	유가(Dubai) <sup>5)</sup>	78.7	76.5	87.6	82.7	84.9	80.9	80.9	79.8	77.9	79.5	80.7	1.46	-0.30	-4.96	5.46
	금(U\$/oz)	1,824	2,063	2,286	2,327	2,327	2,387	2,387	2,384	2,411	2,448	2,446	-0.05	2.47	5.14	18.58

주 : 1) Fed Funds에 대한 가중평균금리(미연준 자료)  
 2) 뉴욕시간 17:00분 기준(Bloomberg 자료)  
 3) IBA(Intercontinental Exchange Benchmark Administration)가 산출하는 런던은행간 무담보금리로 5개 통화(USD, GBP, EUR, CHF, JPY), 7개 만기별로 고시(산출대상 은행은 통화에 따라 11~16개로 상이)  
 4) 유럽자금시장협회(EMMI)가 발표하는 유로존내 18개 은행간 유로화 단기대출금리  
 5) 현물가격 기준  
 6) 금리는 변동분(bp). 환율, 주가, 상품은 변동률(%). 환율은 (+)인 경우 강세, (-)인 경우 약세. 발표시차로 인해 전일자 값이 없을 경우 전전일자를 기준으로 표시