

금리 및 환율 동향

(2024. 5. 14. - 2024. 5. 20.)

(운용전략팀)한국은행

		22년말	23년말	2월말	3월말	4월말	전주말	5/14	5/15	5/16	5/17	5/20	전일비 ⁶⁾	전주말비 ⁶⁾	전월말비 ⁶⁾	전년말비 ⁶⁾
미 국	Fed Funds ¹⁾	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	5.37	5.37	5.38	5.38	5.39	5.39	5.38	5.38	5.38	0	0	0	3
	T/B(3M)	4.34	5.33	5.38	5.36	5.39	5.39	5.38	5.40	5.40	5.39	5.39	0	0	0	6
	T/B(6M)	4.75	5.25	5.32	5.32	5.39	5.36	5.37	5.35	5.36	5.36	5.37	0	0	-2	12
	T/N(2Y)	4.43	4.25	4.62	4.62	5.04	4.82	4.81	4.72	4.80	4.82	4.85	2	2	-19	60
	T/N(5Y)	4.00	3.85	4.24	4.21	4.72	4.45	4.45	4.35	4.40	4.45	4.47	2	2	-25	62
	T/N(10Y)	3.87	3.88	4.25	4.20	4.68	4.42	4.44	4.34	4.38	4.42	4.44	2	2	-24	56
	T/B(30Y)	3.96	4.03	4.38	4.34	4.78	4.56	4.59	4.50	4.51	4.56	4.58	3	3	-20	56
내 국	G/B(2Y)	2.76	2.40	2.90	2.85	3.03	2.99	2.99	2.90	2.93	2.99	2.99	1	1	-4	59
	G/B(5Y)	2.58	1.95	2.43	2.32	2.62	2.56	2.58	2.46	2.50	2.56	2.57	1	1	-4	63
	G/B(10Y)	2.57	2.02	2.41	2.30	2.58	2.52	2.55	2.42	2.46	2.52	2.53	1	1	-6	51
영 국	G/B(2Y)	3.58	3.98	4.30	4.17	4.51	4.31	4.32	4.24	4.27	4.31	4.35	4	4	-16	36
	G/B(5Y)	3.62	3.46	4.04	3.82	4.25	4.01	4.05	3.95	3.97	4.01	4.05	4	4	-20	58
	G/B(10Y)	3.67	3.54	4.12	3.93	4.35	4.13	4.17	4.07	4.08	4.13	4.17	4	4	-18	63
	G/B(30Y)	3.96	4.14	4.57	4.42	4.79	4.60	4.65	4.54	4.56	4.60	4.65	5	5	-14	51
프 랑스	G/B(2Y)	0.04	0.05	0.18	0.19	0.29	0.34	0.34	0.34	0.33	0.34	0.34	1	1	5	29
	G/B(5Y)	0.23	0.21	0.36	0.36	0.48	0.55	0.56	0.56	0.54	0.55	0.58	3	3	10	37
	G/B(10Y)	0.42	0.61	0.71	0.73	0.88	0.95	0.95	0.96	0.93	0.95	0.98	3	3	10	37
캐 나 다	G/B(2Y)	4.05	3.89	4.18	4.18	4.35	4.23	4.27	4.18	4.19	4.23	4.23	0	0	-11	34
	G/B(5Y)	3.41	3.18	3.57	3.53	3.87	3.70	3.76	3.63	3.64	3.70	3.70	0	0	-17	52
	G/B(10Y)	3.30	3.11	3.49	3.47	3.82	3.63	3.69	3.56	3.56	3.63	3.63	0	0	-19	52
호 주	G/B(2Y)	3.40	3.71	3.80	3.76	4.10	3.91	4.01	4.02	3.90	3.91	3.94	3	3	-16	23
	G/B(5Y)	3.68	3.64	3.75	3.61	4.10	3.89	4.01	4.00	3.88	3.89	3.92	3	3	-18	29
	G/B(10Y)	4.05	3.96	4.14	3.96	4.42	4.21	4.33	4.32	4.19	4.21	4.24	3	3	-19	28
스 위 스	G/B(2Y)	1.27	1.11	1.02	0.91	0.94	0.98	1.01	0.97	0.96	0.98	0.98	0	0	4	-12
	G/B(5Y)	1.47	0.80	0.83	0.74	0.82	0.86	0.86	0.83	0.84	0.86	0.86	0	0	4	6
	G/B(10Y)	1.62	0.70	0.80	0.69	0.77	0.78	0.81	0.75	0.76	0.78	0.78	0	0	1	8
제 국	G/B(3Y)	2.40	2.29	2.10	2.03	1.98	1.92	1.95	1.94	1.97	1.92	1.93	1	1	-5	-36
	G/B(5Y)	2.64	2.40	2.22	2.20	2.15	2.09	2.09	2.09	2.10	2.09	2.10	1	1	-5	-30
	G/B(10Y)	2.84	2.56	2.34	2.29	2.30	2.31	2.29	2.30	2.31	2.31	2.31	0	0	1	-24
환 율 ²⁾	DXY	103.52	101.33	104.16	104.49	106.22	104.45	105.01	104.35	104.46	104.45	104.57	0.11	0.11	-1.56	3.19
	EURUSD	1.0705	1.1039	1.0805	1.0790	1.0666	1.0869	1.0819	1.0884	1.0867	1.0869	1.0857	-0.11	-0.11	1.79	-1.65
	USDJPY	131.12	141.04	149.98	151.35	157.80	155.65	156.42	154.88	155.39	155.65	156.26	-0.39	-0.39	0.99	-9.74
	GBPUSD	1.2083	1.2731	1.2625	1.2623	1.2492	1.2701	1.2592	1.2685	1.2670	1.2701	1.2706	0.04	0.04	1.71	-0.20
	USDCAD	1.3554	1.3243	1.3579	1.3540	1.3778	1.3612	1.3651	1.3602	1.3618	1.3612	1.3625	-0.10	-0.10	1.12	-2.80
	AUDUSD	0.6813	0.6812	0.6497	0.6521	0.6473	0.6693	0.6627	0.6694	0.6679	0.6693	0.6667	-0.39	-0.39	3.00	-2.13
	USDCHF	0.9245	0.8414	0.8845	0.9014	0.9194	0.9091	0.9065	0.9022	0.9062	0.9091	0.9106	-0.16	-0.16	0.97	-7.60
	USDCNY	6.8986	7.1000	7.1886	7.2224	7.2411	7.2243	7.2337	7.2190	7.2214	7.2243	7.2354	-0.15	-0.15	0.08	-1.87
	SDRUSD	1.3308	1.3447	1.3276	1.3241	1.3179	1.3238	1.3211	1.3233	1.3263	1.3238	1.3254	-0.12	-0.12	-0.56	1.46
	EURJPY	140.36	155.69	162.05	163.31	168.31	169.18	169.23	168.57	168.86	169.18	169.65	-0.28	-0.28	-0.79	-8.23
L I B O R ³⁾	USD(3M)	4.7673	5.5930	5.5951	5.5598	5.5898	5.5874	5.5883	5.5909	5.5874	5.5874	-	0.01	0.00	-0.23	-0.56
	USD(6M)	5.1389	5.5860	5.7032	5.6461	5.7398	5.7115	5.7218	5.7240	5.7063	5.7115	-	0.51	0.00	-2.83	12.55
	Euribor(3M) ⁴⁾	2.1320	3.9090	3.9370	3.8920	3.8250	3.8300	3.8240	3.8160	3.8260	3.8300	-	0.40	0.00	0.50	-7.90
	JPY(3M)	-0.0262	-0.0070	-0.0038	0.0050	0.0380	0.0531	0.0513	0.0522	0.0531	0.0531	0.0567	0.36	0.36	1.87	6.37
	GBP(3M)	3.8740	5.3246	5.3402	5.3405	5.3434	5.3454	5.3456	5.3452	5.3454	5.3454	5.3456	0.02	0.02	0.22	2.10
주 가	미국(DJIA)	33,147	37,690	38,996	39,807	37,816	40,004	39,558	39,908	39,869	40,004	39,807	-0.49	-0.49	5.26	5.62
	미국(Nasdaq)	10,466	15,011	16,092	16,379	15,658	16,686	16,511	16,742	16,698	16,686	16,795	0.65	0.65	7.26	11.88
	독일(DAX)	13,924	16,752	17,678	18,492	17,932	18,704	18,716	18,869	18,739	18,704	18,769	0.35	0.35	4.67	12.04
	일본(Nikkei)	26,095	33,464	39,166	40,369	38,406	38,787	38,356	38,386	38,920	38,787	39,070	0.73	0.73	1.73	16.75
	중국(Shanghai)	3,089	2,975	3,015	3,041	3,105	3,154	3,146	3,120	3,122	3,154	3,171	0.54	0.54	2.14	6.60
상 품	유가(WTI) ⁵⁾	80.3	71.7	78.3	83.2	81.9	80.1	78.0	78.6	79.2	80.1	79.8	-0.32	-0.32	-2.60	11.37
	유가(Dubai) ⁵⁾	78.7	76.5	80.5	86.8	87.6	83.6	83.9	83.1	82.7	83.6	83.9	0.31	0.31	-4.27	9.59
	금(U\$/oz)	1,824	2,063	2,044	2,230	2,286	2,415	2,358	2,386	2,377	2,415	2,425	0.42	0.42	6.08	17.56

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