

금리 및 환율 동향

(2024. 9. 2. - 2024. 9. 6.)

(운용전략팀)한국은행

		22년말	23년말	6월말	7월말	8월말	전주말	9/2	9/3	9/4	9/5	9/6	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	5.39	5.29	5.07	5.07	5.07	5.00	5.07	4.97	5.00	3	-7	-7	-36	
	T/B(3M)	4.34	5.33	5.35	5.28	5.11	5.11	5.11	5.11	5.11	5.08	5.06	5.05	-1	-6	-6	-28
	T/B(6M)	4.75	5.25	5.32	5.09	4.86	4.86	4.86	4.84	4.76	4.75	4.72	4.72	-3	-14	-14	-53
	T/N(2Y)	4.43	4.25	4.75	4.26	3.92	3.92	3.92	3.86	3.75	3.74	3.65	3.65	-10	-27	-27	-60
	T/N(5Y)	4.00	3.85	4.38	3.91	3.70	3.70	3.70	3.64	3.55	3.54	3.49	3.49	-5	-22	-22	-36
	T/N(10Y)	3.87	3.88	4.40	4.03	3.90	3.90	3.90	3.83	3.76	3.73	3.71	3.71	-2	-20	-20	-17
	T/B(30Y)	3.96	4.03	4.56	4.30	4.20	4.20	4.20	4.12	4.06	4.02	4.02	4.02	0	-18	-18	-1
내 국	G/B(2Y)	2.76	2.40	2.83	2.53	2.39	2.39	2.42	2.38	2.32	2.30	2.23	2.23	-7	-16	-16	-17
	G/B(5Y)	2.58	1.95	2.48	2.23	2.19	2.19	2.23	2.17	2.11	2.10	2.05	2.05	-5	-14	-14	10
	G/B(10Y)	2.57	2.02	2.50	2.30	2.30	2.30	2.34	2.28	2.22	2.21	2.17	2.17	-4	-13	-13	15
영 국	G/B(2Y)	3.58	3.98	4.22	3.83	4.11	4.11	4.12	4.08	4.03	4.01	3.95	3.95	-5	-16	-16	-3
	G/B(5Y)	3.62	3.46	4.02	3.77	3.91	3.91	3.93	3.88	3.83	3.81	3.77	3.77	-3	-14	-14	31
	G/B(10Y)	3.67	3.54	4.17	3.97	4.02	4.02	4.06	3.99	3.94	3.92	3.89	3.89	-3	-13	-13	35
	G/B(30Y)	3.96	4.14	4.66	4.54	4.53	4.53	4.57	4.51	4.47	4.44	4.43	4.43	-1	-10	-10	29
일 국	G/B(2Y)	0.04	0.05	0.37	0.46	0.37	0.37	0.38	0.39	0.38	0.38	0.38	0.38	0	1	1	33
	G/B(5Y)	0.23	0.21	0.59	0.67	0.51	0.51	0.52	0.54	0.51	0.51	0.50	0.50	-1	-1	-1	29
	G/B(10Y)	0.42	0.61	1.06	1.06	0.90	0.90	0.91	0.93	0.88	0.88	0.85	0.85	-3	-4	-4	24
캐 나 다	G/B(2Y)	4.05	3.89	4.00	3.45	3.33	3.33	3.33	3.25	3.15	3.14	3.05	3.05	-9	-28	-28	-84
	G/B(5Y)	3.41	3.18	3.51	3.09	3.04	3.04	3.04	2.95	2.86	2.84	2.80	2.80	-4	-23	-23	-37
	G/B(10Y)	3.30	3.11	3.50	3.16	3.16	3.16	3.16	3.06	2.99	2.97	2.96	2.96	-1	-20	-20	-15
호 주	G/B(2Y)	3.40	3.71	4.16	3.88	3.67	3.67	3.73	3.72	3.69	3.67	3.63	3.63	-4	-4	-4	-8
	G/B(5Y)	3.68	3.64	4.07	3.78	3.59	3.59	3.64	3.63	3.60	3.56	3.52	3.52	-4	-7	-7	-12
	G/B(10Y)	4.05	3.96	4.31	4.12	3.97	3.97	4.01	4.00	3.95	3.93	3.88	3.88	-5	-9	-9	-7
스 위 스	G/B(2Y)	1.27	1.11	0.80	0.66	0.59	0.59	0.58	0.56	0.55	0.56	0.56	0.56	-1	-3	-3	-55
	G/B(5Y)	1.47	0.80	0.67	0.53	0.52	0.52	0.51	0.48	0.47	0.48	0.48	0.48	-1	-4	-4	-33
	G/B(10Y)	1.62	0.70	0.60	0.45	0.48	0.48	0.49	0.46	0.45	0.47	0.47	0.47	0	0	0	-23
제 국	G/B(3Y)	2.40	2.29	1.80	1.71	1.67	1.67	1.62	1.57	1.57	1.55	1.55	1.55	0	-12	-12	-74
	G/B(5Y)	2.64	2.40	1.98	1.85	1.85	1.85	1.81	1.79	1.78	1.78	1.78	1.78	0	-7	-7	-62
	G/B(10Y)	2.84	2.56	2.21	2.15	2.17	2.17	2.15	2.14	2.13	2.13	2.14	2.14	0	-3	-3	-42
환 율 ²⁾	DXY	103.52	101.33	105.87	104.10	101.70	101.70	101.65	101.83	101.36	101.11	101.18	101.18	0.07	-0.51	-0.51	-0.15
	EURUSD	1.0705	1.1039	1.0713	1.0826	1.1048	1.1048	1.1072	1.1043	1.1082	1.1111	1.1084	1.1084	-0.24	0.33	0.33	0.41
	USDJPY	131.12	141.04	160.88	149.98	146.17	146.17	146.92	145.48	143.74	143.45	142.30	142.30	0.81	2.72	2.72	-0.89
	GBPUSD	1.2083	1.2731	1.2645	1.2856	1.3127	1.3127	1.3146	1.3114	1.3147	1.3180	1.3129	1.3129	-0.39	0.02	0.02	3.13
	USDCAD	1.3554	1.3243	1.3679	1.3808	1.3492	1.3492	1.3494	1.3551	1.3506	1.3503	1.3573	1.3573	-0.52	-0.60	-0.60	-2.43
	AUDUSD	0.6813	0.6812	0.6670	0.6542	0.6765	0.6765	0.6791	0.6711	0.6725	0.6741	0.6671	0.6671	-1.04	-1.39	-1.39	-2.07
	USDCHF	0.9245	0.8414	0.8988	0.8780	0.8496	0.8496	0.8517	0.8503	0.8465	0.8440	0.8430	0.8430	0.12	0.78	0.78	-0.19
	USDCNY	6.8986	7.1000	7.2673	7.2267	7.0913	7.0913	7.1173	7.1217	7.1130	7.0887	7.0980	7.0980	-0.13	-0.09	-0.09	0.03
	SDRUSD	1.3308	1.3447	1.3153	1.3284	1.3466	1.3466	1.3466	1.3431	1.3444	1.3481	1.3492	1.3492	-0.08	-0.19	-0.19	-0.33
	EURJPY	140.36	155.69	172.35	162.37	161.49	161.49	162.67	160.65	159.29	159.39	157.73	157.73	1.05	2.39	2.39	-1.29
L I B O R ³⁾	USD(3M)	4.7673	5.5930	5.5862	5.5027	5.2782	5.2782	5.2782	5.2731	5.2560	5.2077	5.2003	5.2003	-0.74	-7.80	-7.80	-39.28
	USD(6M)	5.1389	5.5860	5.6830	5.5038	5.1370	5.1370	5.1370	5.1364	5.1132	5.0437	5.0203	5.0203	-2.34	-11.68	-11.68	-56.57
	Euribor(3M) ⁴⁾	2.1320	3.9090	3.7110	3.6470	3.4900	3.4900	3.4690	3.4580	3.4490	3.4700	3.4680	3.4680	-0.20	-2.20	-2.20	-44.10
	JPY(3M)	-0.0262	-0.0070	0.0844	0.0847	0.1313	0.1313	0.1318	0.1377	0.1393	0.1409	0.1426	0.1426	0.16	1.13	1.13	14.96
주 가	미국(DJIA)	33,147	37,690	39,119	40,843	41,563	41,563	41,563	40,937	40,975	40,756	40,345	40,345	-1.01	-2.93	-2.93	7.05
	미국(Nasdaq)	10,466	15,011	17,733	17,599	17,714	17,714	17,714	17,136	17,084	17,128	16,691	16,691	-2.55	-5.77	-5.77	11.19
	독일(DAX)	13,924	16,752	18,235	18,509	18,907	18,907	18,931	18,747	18,592	18,577	18,302	18,302	-1.48	-3.20	-3.20	9.25
	일본(Nikkei)	26,095	33,464	39,583	39,102	38,648	38,648	38,701	38,686	37,048	36,657	36,391	36,391	-0.72	-5.84	-5.84	8.75
	중국(Shanghai)	3,089	2,975	2,967	2,939	2,842	2,842	2,811	2,803	2,784	2,788	2,766	2,766	-0.81	-2.69	-2.69	-7.03
상 품	유가(WTI) ⁵⁾	80.3	71.7	81.5	77.9	73.6	73.6	73.6	70.3	69.2	69.2	67.7	67.7	-2.14	-7.99	-7.99	-5.55
	유가(Dubai) ⁵⁾	78.7	76.5	84.9	79.5	77.1	77.1	76.8	76.2	74.2	73.6	73.3	73.3	-0.39	-4.91	-4.91	-4.16
	금(U\$/oz)	1,824	2,063	2,327	2,448	2,503	2,503	2,500	2,493	2,496	2,517	2,497	2,497	-0.77	-0.24	-0.24	21.06

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