

# 금리 및 환율 동향

## (2024. 9. 30. - 2024. 10. 4.)

(운용전략팀)한국은행

		22년말	23년말	7월말	8월말	9월말	전주말	9/30	10/1	10/2	10/3	10/4	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	4.83	4.83	4.83	4.83	4.83	4.83	4.83	-	0	0	0	-50
	C/D(3M)	4.58	5.35	5.29	5.07	4.71	4.69	4.71	4.69	4.72	4.68	4.68	0	-1	-3	-67	
	T/B(3M)	4.34	5.33	5.28	5.11	4.62	4.60	4.62	4.57	4.59	4.58	4.61	3	1	0	-72	
	T/B(6M)	4.75	5.25	5.09	4.86	4.40	4.38	4.40	4.36	4.36	4.37	4.44	7	6	4	-81	
	T/N(2Y)	4.43	4.25	4.26	3.92	3.64	3.56	3.64	3.60	3.64	3.71	3.92	22	36	28	-33	
	T/N(5Y)	4.00	3.85	3.91	3.70	3.56	3.51	3.56	3.51	3.55	3.63	3.80	18	30	25	-4	
	T/N(10Y)	3.87	3.88	4.03	3.90	3.78	3.75	3.75	3.78	3.73	3.78	3.85	3.97	12	22	19	9
	T/B(30Y)	3.96	4.03	4.30	4.20	4.12	4.10	4.12	4.07	4.13	4.18	4.18	4.25	7	15	13	22
캐 나 다	G/B(2Y)	2.76	2.40	2.53	2.39	2.07	2.08	2.07	2.02	2.04	2.08	2.20	12	13	14	-20	
	G/B(5Y)	2.58	1.95	2.23	2.19	1.95	1.95	1.95	1.88	1.92	1.97	2.07	10	12	12	12	
	G/B(10Y)	2.57	2.02	2.30	2.30	2.12	2.13	2.12	2.04	2.09	2.14	2.21	7	8	9	19	
영 국	G/B(2Y)	3.58	3.98	3.83	4.11	3.98	3.94	3.98	3.96	4.02	3.97	4.14	17	20	16	16	
	G/B(5Y)	3.62	3.46	3.77	3.91	3.86	3.82	3.86	3.82	3.90	3.87	4.02	15	19	16	55	
	G/B(10Y)	3.67	3.54	3.97	4.02	4.00	3.98	4.00	3.94	4.03	4.02	4.13	11	15	13	59	
	G/B(30Y)	3.96	4.14	4.54	4.53	4.58	4.58	4.58	4.51	4.59	4.60	4.68	8	10	9	53	
프 랜 스	G/B(2Y)	0.04	0.05	0.46	0.37	0.39	0.37	0.39	0.39	0.37	0.37	0.37	0	1	-2	32	
	G/B(5Y)	0.23	0.21	0.67	0.51	0.51	0.50	0.51	0.50	0.49	0.49	0.50	1	0	-1	29	
	G/B(10Y)	0.42	0.61	1.06	0.90	0.86	0.85	0.86	0.86	0.83	0.83	0.89	5	3	3	27	
캐 나 다	G/B(2Y)	4.05	3.89	3.45	3.33	2.91	2.91	2.91	2.93	2.99	3.05	3.23	18	32	32	-66	
	G/B(5Y)	3.41	3.18	3.09	3.04	2.74	2.74	2.74	2.75	2.81	2.88	3.02	14	28	28	-16	
	G/B(10Y)	3.30	3.11	3.16	3.16	2.96	2.96	2.96	2.95	3.03	3.10	3.20	10	24	24	9	
주 위 스	G/B(2Y)	3.40	3.71	3.88	3.67	3.64	3.63	3.64	3.61	3.56	3.61	3.67	6	3	2	-4	
	G/B(5Y)	3.68	3.64	3.78	3.59	3.58	3.57	3.58	3.65	3.60	3.64	3.71	7	14	13	7	
	G/B(10Y)	4.05	3.96	4.12	3.97	3.97	3.96	3.97	4.01	3.95	4.01	4.07	6	12	10	12	
스 위 스	G/B(2Y)	1.27	1.11	0.66	0.59	0.44	0.47	0.44	0.43	0.45	0.42	0.49	7	2	5	-62	
	G/B(5Y)	1.47	0.80	0.53	0.52	0.39	0.41	0.39	0.37	0.40	0.41	0.45	5	5	7	-35	
	G/B(10Y)	1.62	0.70	0.45	0.48	0.41	0.41	0.41	0.39	0.43	0.43	0.46	4	5	5	-24	
코 리 아	G/B(3Y)	2.40	2.29	1.71	1.67	1.56	1.56	1.56	1.56	1.56	1.56	1.56	0	0	0	-73	
	G/B(5Y)	2.64	2.40	1.85	1.85	1.84	1.83	1.84	1.84	1.84	1.84	1.84	0	1	0	-56	
	G/B(10Y)	2.84	2.56	2.15	2.17	2.15	2.17	2.15	2.15	2.15	2.15	2.15	0	-2	0	-40	
환 율 <sup>2)</sup>	DXY	103.52	101.33	104.10	101.70	100.78	100.38	100.78	101.19	101.68	101.99	102.52	0.52	2.13	1.73	1.17	
	EURUSD	1.0705	1.1039	1.0826	1.1048	1.1135	1.1162	1.1135	1.1068	1.1045	1.1031	1.0974	-0.52	-1.68	-1.45	-0.59	
	USDJPY	131.12	141.04	149.98	146.17	143.63	142.21	143.63	143.57	146.47	146.93	148.70	-1.19	-4.36	-3.41	-5.15	
	GBPUSD	1.2083	1.2731	1.2856	1.3127	1.3375	1.3374	1.3375	1.3286	1.3268	1.3124	1.3122	-0.02	-1.88	-1.89	3.07	
	USDCAD	1.3554	1.3243	1.3808	1.3492	1.3525	1.3516	1.3525	1.3490	1.3502	1.3555	1.3576	-0.15	-0.44	-0.38	-2.45	
	AUDUSD	0.6813	0.6812	0.6542	0.6765	0.6913	0.6903	0.6913	0.6883	0.6885	0.6840	0.6795	-0.66	-1.56	-1.71	-0.25	
	USDCHF	0.9245	0.8414	0.8780	0.8496	0.8456	0.8406	0.8456	0.8466	0.8497	0.8529	0.8584	-0.64	-2.07	-1.49	-1.98	
	USDCNY	6.8986	7.1000	7.2267	7.0913	7.0187	7.0111	7.0187	7.0187	7.0187	7.0187	7.0187	0.00	-0.11	0.00	1.16	
	SDRUSD	1.3308	1.3447	1.3284	1.3466	1.3564	1.3550	1.3564	1.3505	1.3484	1.3447	1.3442	0.03	0.80	0.90	0.04	
	EURJPY	140.36	155.69	162.37	161.49	159.93	158.73	159.93	158.90	161.78	162.08	163.18	-0.68	-2.73	-1.99	-4.59	
L I B O R <sup>3)</sup>	USD(3M)	4.7673	5.5930	5.5027	5.2782	4.8537	4.8550	4.8537	4.8537	4.8537	4.8537	-	0.00	-0.12	0.00	-73.93	
	USD(6M)	5.1389	5.5860	5.5038	5.1370	4.6821	4.6901	4.6821	4.6821	4.6821	4.6821	-	0.00	-0.80	0.00	-90.39	
	Euribor(3M) <sup>4)</sup>	2.1320	3.9090	3.6470	3.4900	3.2790	3.3260	3.2790	3.2520	3.2460	3.2380	3.2500	1.20	-7.60	-2.90	-65.90	
	JPY(3M)	-0.0262	-0.0070	0.0847	0.1313	0.1789	0.1762	0.1789	0.1826	0.1842	0.1858	0.1874	0.16	1.12	0.85	19.45	
	GBP(3M)	3.8740	5.3246	5.3524	5.2785	5.1987	5.2015	5.1987	5.1959	5.1919	5.1849	5.1822	-0.27	-1.93	-1.65	-14.24	
주 가	미국(DJIA)	33,147	37,690	40,843	41,563	42,330	42,313	42,330	42,157	42,197	42,012	42,353	0.81	0.09	0.05	12.37	
	미국(Nasdaq)	10,466	15,011	17,599	17,714	18,189	18,120	18,189	17,910	17,925	17,918	18,138	1.22	0.10	-0.28	20.83	
	독일(DAX)	13,924	16,752	18,509	18,907	19,325	19,474	19,325	19,213	19,165	19,015	19,121	0.55	-1.81	-1.06	14.14	
	일본(Nikkei)	26,095	33,464	39,102	38,648	37,920	39,830	37,920	38,652	37,809	38,552	38,636	0.22	-3.00	1.89	15.45	
	중국(Shanghai)	3,089	2,975	2,939	2,842	3,336	3,088	3,336	3,336	3,336	3,336	3,336	0.00	8.06	0.00	12.15	
상 품	유가(WTI) <sup>5)</sup>	80.3	71.7	77.9	73.6	68.2	68.2	68.2	69.8	70.1	73.7	74.4	0.91	9.09	9.11	3.81	
	유가(Dubai) <sup>5)</sup>	78.7	76.5	79.5	77.1	72.5	71.3	72.5	69.6	75.4	74.6	77.8	4.34	9.10	7.29	1.71	
	금(U\$/oz)	1,824	2,063	2,448	2,503	2,635	2,658	2,635	2,663	2,659	2,656	2,654	-0.09	-0.17	0.72	28.63	

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