

금리 및 환율 동향

(2024. 8. 29. - 2024. 9. 4.)

(운용전략팀)한국은행

		22년말	23년말	6월말	7월말	8월말	전주말	8/29	8/30	9/2	9/3	9/4	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	5.33	-	0	0	0		
	C/D(3M)	4.58	5.35	5.39	5.29	5.07	5.07	5.05	5.07	5.07	5.07	5.00	5.07	8	1	1	-28	
	T/B(3M)	4.34	5.33	5.35	5.28	5.11	5.11	5.12	5.11	5.11	5.11	5.11	5.08	-3	-3	-3	-26	
	T/B(6M)	4.75	5.25	5.32	5.09	4.86	4.86	4.86	4.86	4.86	4.86	4.84	4.76	-8	-10	-10	-49	
	T/N(2Y)	4.43	4.25	4.75	4.26	3.92	3.92	3.89	3.92	3.92	3.92	3.86	3.75	-11	-16	-16	-50	
	T/N(5Y)	4.00	3.85	4.38	3.91	3.70	3.70	3.67	3.70	3.70	3.70	3.64	3.55	-9	-15	-15	-30	
	T/N(10Y)	3.87	3.88	4.40	4.03	3.90	3.90	3.86	3.90	3.90	3.90	3.83	3.76	-8	-15	-15	-12	
	T/B(30Y)	3.96	4.03	4.56	4.30	4.20	4.20	4.15	4.20	4.20	4.20	4.12	4.06	-7	-14	-14	3	
내 국	G/B(2Y)	2.76	2.40	2.83	2.53	2.39	2.39	2.36	2.39	2.42	2.38	2.32	2.32	-6	-7	-7	-8	
	G/B(5Y)	2.58	1.95	2.48	2.23	2.19	2.19	2.16	2.19	2.23	2.17	2.11	2.11	-6	-8	-8	16	
	G/B(10Y)	2.57	2.02	2.50	2.30	2.30	2.30	2.27	2.30	2.34	2.28	2.22	2.22	-5	-7	-7	20	
영 국	G/B(2Y)	3.58	3.98	4.22	3.83	4.11	4.11	4.11	4.11	4.12	4.08	4.03	4.03	-5	-8	-8	5	
	G/B(5Y)	3.62	3.46	4.02	3.77	3.91	3.91	3.92	3.91	3.93	3.88	3.83	3.83	-5	-8	-8	37	
	G/B(10Y)	3.67	3.54	4.17	3.97	4.02	4.02	4.02	4.02	4.06	3.99	3.94	3.94	-6	-8	-8	40	
	G/B(30Y)	3.96	4.14	4.66	4.54	4.53	4.53	4.54	4.53	4.57	4.51	4.47	4.47	-4	-6	-6	33	
프 랑스	G/B(2Y)	0.04	0.05	0.37	0.46	0.37	0.37	0.37	0.37	0.38	0.39	0.38	0.38	-1	1	1	33	
	G/B(5Y)	0.23	0.21	0.59	0.67	0.51	0.51	0.51	0.51	0.52	0.54	0.51	0.51	-2	1	1	31	
	G/B(10Y)	0.42	0.61	1.06	1.06	0.90	0.90	0.90	0.90	0.91	0.93	0.88	0.88	-4	-1	-1	27	
캐 나다	G/B(2Y)	4.05	3.89	4.00	3.45	3.33	3.33	3.32	3.33	3.33	3.33	3.25	3.15	-9	-18	-18	-74	
	G/B(5Y)	3.41	3.18	3.51	3.09	3.04	3.04	3.02	3.04	3.04	3.04	2.95	2.86	-9	-18	-18	-31	
	G/B(10Y)	3.30	3.11	3.50	3.16	3.16	3.16	3.13	3.16	3.16	3.16	3.06	2.99	-7	-17	-17	-12	
호 주	G/B(2Y)	3.40	3.71	4.16	3.88	3.67	3.67	3.67	3.67	3.73	3.72	3.69	3.69	-3	2	2	-2	
	G/B(5Y)	3.68	3.64	4.07	3.78	3.59	3.59	3.59	3.59	3.64	3.63	3.60	3.60	-4	0	0	-4	
	G/B(10Y)	4.05	3.96	4.31	4.12	3.97	3.97	3.95	3.97	4.01	4.00	3.95	3.95	-5	-2	-2	0	
스 위 스	G/B(2Y)	1.27	1.11	0.80	0.66	0.59	0.59	0.57	0.59	0.58	0.56	0.55	0.55	-1	-4	-4	-55	
	G/B(5Y)	1.47	0.80	0.67	0.53	0.52	0.52	0.50	0.52	0.51	0.48	0.47	0.47	-1	-5	-5	-34	
	G/B(10Y)	1.62	0.70	0.60	0.45	0.48	0.48	0.47	0.48	0.49	0.46	0.45	0.45	-1	-3	-3	-25	
제 국	G/B(3Y)	2.40	2.29	1.80	1.71	1.67	1.67	1.68	1.67	1.62	1.57	1.57	1.57	-1	-10	-10	-72	
	G/B(5Y)	2.64	2.40	1.98	1.85	1.85	1.85	1.87	1.85	1.81	1.79	1.78	1.78	-1	-8	-8	-63	
	G/B(10Y)	2.84	2.56	2.21	2.15	2.17	2.17	2.17	2.17	2.15	2.14	2.13	2.13	-1	-4	-4	-42	
환 율 ²⁾	DXY	103.52	101.33	105.87	104.10	101.70	101.70	101.34	101.70	101.65	101.83	101.36	101.36	-0.46	-0.33	-0.33	0.02	
	EURUSD	1.0705	1.1039	1.0713	1.0826	1.1048	1.1048	1.1077	1.1048	1.1072	1.1043	1.1082	1.1082	0.35	0.31	0.31	0.39	
	USDJPY	131.12	141.04	160.88	149.98	146.17	146.17	144.99	146.17	146.92	145.48	143.74	143.74	1.21	1.69	1.69	-1.88	
	GBPUSD	1.2083	1.2731	1.2645	1.2856	1.3127	1.3127	1.3168	1.3127	1.3146	1.3114	1.3147	1.3147	0.25	0.15	0.15	3.27	
	USDCAD	1.3554	1.3243	1.3679	1.3808	1.3492	1.3492	1.3485	1.3492	1.3494	1.3551	1.3506	1.3506	0.33	-0.10	-0.10	-1.95	
	AUDUSD	0.6813	0.6812	0.6670	0.6542	0.6765	0.6765	0.6798	0.6765	0.6791	0.6711	0.6725	0.6725	0.21	-0.59	-0.59	-1.28	
	USDCHF	0.9245	0.8414	0.8988	0.8780	0.8496	0.8496	0.8473	0.8496	0.8517	0.8503	0.8465	0.8465	0.45	0.37	0.37	-0.60	
	USDCNY	6.8986	7.1000	7.2673	7.2267	7.0913	7.0913	7.0970	7.0913	7.1173	7.1217	7.1130	7.1130	0.12	-0.31	-0.31	-0.18	
	SDRUSD	1.3308	1.3447	1.3153	1.3284	1.3466	1.3466	1.3478	1.3466	1.3466	1.3431	1.3444	1.3444	-0.10	0.16	0.16	0.02	
	EURJPY	140.36	155.69	172.35	162.37	161.49	161.49	160.61	161.49	162.67	160.65	159.29	159.29	0.85	1.38	1.38	-2.26	
L I B O R ³⁾	USD(3M)	4.7673	5.5930	5.5862	5.5027	5.2782	5.2782	5.2773	5.2782	5.2782	5.2731	-	-	-0.51	-0.51	-0.51	-31.99	
	USD(6M)	5.1389	5.5860	5.6830	5.5038	5.1370	5.1370	5.1265	5.1370	5.1370	5.1364	-	-	-0.06	-0.06	-0.06	-44.95	
	Euribor(3M) ⁴⁾	2.1320	3.9090	3.7110	3.6470	3.4900	3.4900	3.5050	3.4900	3.4900	3.4690	3.4580	3.4580	-	-1.10	-3.20	-3.20	-45.10
	JPY(3M)	-0.0262	-0.0070	0.0844	0.0847	0.1313	0.1313	0.1297	0.1313	0.1318	0.1377	0.1393	0.1393	0.16	0.80	0.80	14.64	
	GBP(3M)	3.8740	5.3246	5.3513	5.3524	5.2785	5.2785	5.2846	5.2785	5.2757	5.2730	5.2718	5.2718	-0.12	-0.67	-0.67	-5.28	
주 가	미국(DJIA)	33,147	37,690	39,119	40,843	41,563	41,563	41,335	41,563	41,563	40,937	40,975	40,975	0.09	-1.41	-1.41	8.72	
	미국(Nasdaq)	10,466	15,011	17,733	17,599	17,714	17,714	17,516	17,714	17,714	17,136	17,084	17,084	-0.30	-3.55	-3.55	13.81	
	독일(DAX)	13,924	16,752	18,235	18,509	18,907	18,907	18,913	18,907	18,931	18,747	18,592	18,592	-0.83	-1.67	-1.67	10.99	
	일본(Nikkei)	26,095	33,464	39,583	39,102	38,648	38,648	38,363	38,648	38,701	38,686	37,048	37,048	-4.24	-4.14	-4.14	10.71	
	중국(Shanghai)	3,089	2,975	2,967	2,939	2,842	2,842	2,823	2,842	2,811	2,803	2,784	2,784	-0.67	-2.04	-2.04	-6.41	
상 품	유가(WTI) ⁵⁾	80.3	71.7	81.5	77.9	73.6	73.6	75.9	73.6	73.6	70.3	69.2	69.2	-1.62	-5.91	-5.91	-3.42	
	유가(Dubai) ⁵⁾	78.7	76.5	84.9	79.5	77.1	77.1	75.6	77.1	76.8	74.2	74.2	74.2	-2.60	-3.80	-3.80	-3.03	
	금(U\$/oz)	1,824	2,063	2,327	2,448	2,503	2,503	2,521	2,503	2,500	2,493	2,496	2,496	0.11	-0.31	-0.31	20.98	

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, 상품 변동률(%). 환율은 (+)인 경우 강세, (-)인 경우 약세. 발표시차로 인해 전일자 값이 없을 경우 전전일자를 기준으로 표시