

금리 및 환율 동향

(2024. 5. 13. - 2024. 5. 17.)

(운용전략팀)한국은행

		22년말	23년말	2월말	3월말	4월말	전주말	5/13	5/14	5/15	5/16	5/17	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	5.37	5.39	5.39	5.39	5.38	5.38	1	1	0	3	
	T/B(3M)	4.34	5.33	5.38	5.36	5.39	5.40	5.38	5.38	5.40	5.40	5.39	-1	-1	0	6	
	T/B(6M)	4.75	5.25	5.32	5.32	5.39	5.37	5.38	5.37	5.35	5.36	5.36	1	-1	-3	12	
	T/N(2Y)	4.43	4.25	4.62	4.62	5.04	4.87	4.86	4.81	4.72	4.80	4.82	3	-4	-21	57	
	T/N(5Y)	4.00	3.85	4.24	4.21	4.72	4.51	4.51	4.45	4.35	4.40	4.45	5	-7	-27	60	
	T/N(10Y)	3.87	3.88	4.25	4.20	4.68	4.50	4.49	4.44	4.34	4.38	4.42	4	-8	-26	54	
	T/B(30Y)	3.96	4.03	4.38	4.34	4.78	4.64	4.63	4.59	4.50	4.51	4.56	5	-8	-23	53	
영 국	G/B(2Y)	2.76	2.40	2.90	2.85	3.03	2.97	2.96	2.99	2.90	2.93	2.99	6	2	-5	58	
	G/B(5Y)	2.58	1.95	2.43	2.32	2.62	2.55	2.54	2.58	2.46	2.50	2.56	6	1	-6	61	
	G/B(10Y)	2.57	2.02	2.41	2.30	2.58	2.52	2.51	2.55	2.42	2.46	2.52	6	0	-7	49	
영 국	G/B(2Y)	3.58	3.98	4.30	4.17	4.51	4.32	4.33	4.32	4.24	4.27	4.31	4	-1	-20	33	
	G/B(5Y)	3.62	3.46	4.04	3.82	4.25	4.04	4.06	4.05	3.95	3.97	4.01	4	-3	-24	55	
	G/B(10Y)	3.67	3.54	4.12	3.93	4.35	4.17	4.17	4.17	4.07	4.08	4.13	5	-4	-22	59	
	G/B(30Y)	3.96	4.14	4.57	4.42	4.79	4.65	4.66	4.65	4.54	4.56	4.60	4	-4	-19	46	
영 국	G/B(2Y)	0.04	0.05	0.18	0.19	0.29	0.32	0.33	0.34	0.34	0.33	0.34	1	2	5	28	
	G/B(5Y)	0.23	0.21	0.36	0.36	0.48	0.52	0.54	0.56	0.56	0.54	0.55	1	3	7	34	
	G/B(10Y)	0.42	0.61	0.71	0.73	0.88	0.91	0.94	0.95	0.96	0.93	0.95	2	4	7	34	
캐 나 다	G/B(2Y)	4.05	3.89	4.18	4.18	4.35	4.29	4.29	4.27	4.18	4.19	4.23	4	-5	-11	34	
	G/B(5Y)	3.41	3.18	3.57	3.53	3.87	3.77	3.76	3.76	3.63	3.64	3.70	6	-7	-17	52	
	G/B(10Y)	3.30	3.11	3.49	3.47	3.82	3.70	3.68	3.69	3.56	3.56	3.63	6	-7	-19	52	
호 주	G/B(2Y)	3.40	3.71	3.80	3.76	4.10	4.02	4.02	4.01	4.02	3.90	3.91	1	-12	-19	20	
	G/B(5Y)	3.68	3.64	3.75	3.61	4.10	4.02	4.01	4.01	4.00	3.88	3.89	1	-13	-21	26	
	G/B(10Y)	4.05	3.96	4.14	3.96	4.42	4.32	4.33	4.33	4.32	4.19	4.21	2	-11	-21	26	
스 위 스	G/B(2Y)	1.27	1.11	1.02	0.91	0.94	0.99	1.00	1.01	0.97	0.96	0.98	2	-1	4	-12	
	G/B(5Y)	1.47	0.80	0.83	0.74	0.82	0.86	0.87	0.86	0.83	0.84	0.86	2	0	4	6	
	G/B(10Y)	1.62	0.70	0.80	0.69	0.77	0.78	0.80	0.81	0.75	0.76	0.78	2	0	1	8	
제 국	G/B(3Y)	2.40	2.29	2.10	2.03	1.98	1.99	1.95	1.95	1.94	1.97	1.92	-5	-7	-6	-37	
	G/B(5Y)	2.64	2.40	2.22	2.20	2.15	2.13	2.10	2.09	2.09	2.10	2.09	-1	-4	-6	-31	
	G/B(10Y)	2.84	2.56	2.34	2.29	2.30	2.31	2.29	2.29	2.30	2.31	2.31	-1	0	0	-25	
환 율 ²⁾	DXY	103.52	101.33	104.16	104.49	106.22	105.30	105.22	105.01	104.35	104.46	104.45	-0.02	-0.81	-1.67	3.07	
	EURUSD	1.0705	1.1039	1.0805	1.0790	1.0666	1.0771	1.0790	1.0819	1.0884	1.0867	1.0869	0.02	0.91	1.90	-1.54	
	USDJPY	131.12	141.04	149.98	151.35	157.80	155.78	156.22	156.42	154.88	155.39	155.65	-0.17	0.08	1.38	-9.39	
	GBPUSD	1.2083	1.2731	1.2625	1.2623	1.2492	1.2525	1.2559	1.2592	1.2685	1.2670	1.2701	0.24	1.41	1.67	-0.24	
	USDCAD	1.3554	1.3243	1.3579	1.3540	1.3778	1.3672	1.3666	1.3651	1.3602	1.3618	1.3612	0.04	0.44	1.22	-2.71	
	AUDUSD	0.6813	0.6812	0.6497	0.6521	0.6473	0.6604	0.6608	0.6627	0.6694	0.6679	0.6693	0.21	1.35	3.40	-1.75	
	USDCHF	0.9245	0.8414	0.8845	0.9014	0.9194	0.9065	0.9083	0.9065	0.9022	0.9062	0.9091	-0.32	-0.29	1.13	-7.45	
	USDCNY	6.8986	7.1000	7.1886	7.2224	7.2411	7.2269	7.2334	7.2337	7.2190	7.2214	7.2243	-0.04	0.04	0.23	-1.72	
	SDRUSD	1.3308	1.3447	1.3276	1.3241	1.3179	1.3208	1.3206	1.3211	1.3233	1.3263	1.3238	0.19	-0.22	-0.44	1.58	
	EURJPY	140.36	155.69	162.05	163.31	168.31	167.79	168.56	169.23	168.57	168.86	169.18	-0.19	-0.82	-0.51	-7.97	
L I B O R ³⁾	USD(3M)	4.7673	5.5930	5.5951	5.5598	5.5898	5.5836	5.5840	5.5883	5.5909	5.5874	5.5874	0.01	0.38	-0.23	-0.56	
	USD(6M)	5.1389	5.5860	5.7032	5.6461	5.7398	5.7126	5.7168	5.7218	5.7240	5.7063	5.7115	0.51	-0.11	-2.83	12.55	
	Euribor(3M) ⁴⁾	2.1320	3.9090	3.9370	3.8920	3.8250	3.8180	3.8280	3.8240	3.8160	3.8260	3.8300	0.40	1.20	0.50	-7.90	
	JPY(3M)	-0.0262	-0.0070	-0.0038	0.0050	0.0380	0.0468	0.0504	0.0513	0.0522	0.0531	-	-	0.09	0.63	1.51	6.01
	GBP(3M)	3.8740	5.3246	5.3402	5.3405	5.3434	5.3445	5.3447	5.3456	5.3452	5.3454	-	-	0.02	0.09	0.20	2.08
주 가	미국(DJIA)	33,147	37,690	38,996	39,807	37,816	39,513	39,432	39,558	39,908	39,869	40,004	0.34	1.24	5.79	6.14	
	미국(Nasdaq)	10,466	15,011	16,092	16,379	15,658	16,341	16,388	16,511	16,742	16,698	16,686	-0.07	2.11	6.57	11.16	
	독일(DAX)	13,924	16,752	17,678	18,492	17,932	18,773	18,742	18,716	18,869	18,739	18,704	-0.18	-0.36	4.31	11.66	
	일본(Nikkei)	26,095	33,464	39,166	40,369	38,406	38,229	38,179	38,356	38,386	38,920	38,787	-0.34	1.46	0.99	15.91	
	중국(Shanghai)	3,089	2,975	3,015	3,041	3,105	3,155	3,148	3,146	3,120	3,122	3,154	1.01	-0.02	1.58	6.02	
상 품	유가(WTI) ⁵⁾	80.3	71.7	78.3	83.2	81.9	78.3	79.1	78.0	78.6	79.2	80.1	1.05	2.30	-2.28	11.74	
	유가(Dubai) ⁵⁾	78.7	76.5	80.5	86.8	87.6	85.1	83.5	83.9	83.1	82.7	83.6	1.11	-1.73	-4.57	9.25	
	금(U\$/oz)	1,824	2,063	2,044	2,230	2,286	2,361	2,336	2,358	2,386	2,377	2,415	1.61	2.32	5.64	17.07	

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