

금리 및 환율 동향

(2024. 10. 1. - 2024. 10. 7.)

(운용전략팀)한국은행

		22년말	23년말	7월말	8월말	9월말	전주말	10/1	10/2	10/3	10/4	10/7	전일비 ⁶⁾	전주말비 ⁶⁾	전월말비 ⁶⁾	전년말비 ⁶⁾	
미 국	Fed Funds ¹⁾	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	4.68	4.69	4.72	4.68	4.68	4.77	9	9	6	-58	
	T/B(3M)	4.34	5.33	5.28	5.11	4.62	4.61	4.57	4.59	4.58	4.61	4.65	3	3	3	-69	
	T/B(6M)	4.75	5.25	5.09	4.86	4.40	4.44	4.36	4.36	4.37	4.44	4.44	-1	-1	3	-81	
	T/N(2Y)	4.43	4.25	4.26	3.92	3.64	3.92	3.60	3.64	3.71	3.92	4.00	7	7	35	-25	
	T/N(5Y)	4.00	3.85	3.91	3.70	3.56	3.80	3.51	3.55	3.63	3.80	3.87	6	6	31	2	
	T/N(10Y)	3.87	3.88	4.03	3.90	3.78	3.97	3.73	3.78	3.85	3.97	4.03	6	6	24	15	
	T/B(30Y)	3.96	4.03	4.30	4.20	4.12	4.25	4.07	4.13	4.18	4.25	4.30	6	6	19	28	
내 국	G/B(2Y)	2.76	2.40	2.53	2.39	2.07	2.20	2.02	2.04	2.08	2.20	2.25	4	4	18	-16	
	G/B(5Y)	2.58	1.95	2.23	2.19	1.95	2.07	1.88	1.92	1.97	2.07	2.12	5	5	18	18	
	G/B(10Y)	2.57	2.02	2.30	2.30	2.12	2.21	2.04	2.09	2.14	2.21	2.26	5	5	13	23	
영 국	G/B(2Y)	3.58	3.98	3.83	4.11	3.98	4.14	3.96	4.02	3.97	4.14	4.22	8	8	24	24	
	G/B(5Y)	3.62	3.46	3.77	3.91	3.86	4.02	3.82	3.90	3.87	4.02	4.10	9	9	24	64	
	G/B(10Y)	3.67	3.54	3.97	4.02	4.00	4.13	3.94	4.03	4.02	4.13	4.21	8	8	21	67	
	G/B(30Y)	3.96	4.14	4.54	4.53	4.58	4.68	4.51	4.59	4.60	4.68	4.73	5	5	15	59	
프 랑스	G/B(2Y)	0.04	0.05	0.46	0.37	0.39	0.37	0.39	0.37	0.37	0.37	0.42	4	4	3	36	
	G/B(5Y)	0.23	0.21	0.67	0.51	0.51	0.50	0.50	0.49	0.49	0.50	0.55	5	5	4	34	
	G/B(10Y)	0.42	0.61	1.06	0.90	0.86	0.89	0.86	0.83	0.83	0.89	0.93	5	5	7	32	
캐 나 다	G/B(2Y)	4.05	3.89	3.45	3.33	2.91	3.23	2.93	2.99	3.05	3.23	3.29	6	6	38	-60	
	G/B(5Y)	3.41	3.18	3.09	3.04	2.74	3.02	2.75	2.81	2.88	3.02	3.07	5	5	33	-11	
	G/B(10Y)	3.30	3.11	3.16	3.16	2.96	3.20	2.95	3.03	3.10	3.20	3.24	4	4	28	13	
호 주	G/B(2Y)	3.40	3.71	3.88	3.67	3.64	3.67	3.61	3.56	3.61	3.67	3.67	0	0	2	-4	
	G/B(5Y)	3.68	3.64	3.78	3.59	3.58	3.71	3.65	3.60	3.64	3.71	3.71	0	0	13	7	
	G/B(10Y)	4.05	3.96	4.12	3.97	3.97	4.07	4.01	3.95	4.01	4.07	4.07	0	0	10	12	
스 위 스	G/B(2Y)	1.27	1.11	0.66	0.59	0.44	0.49	0.43	0.45	0.42	0.49	0.47	-2	-2	3	-64	
	G/B(5Y)	1.47	0.80	0.53	0.52	0.39	0.45	0.37	0.40	0.41	0.45	0.44	-1	-1	6	-36	
	G/B(10Y)	1.62	0.70	0.45	0.48	0.41	0.46	0.39	0.43	0.43	0.46	0.47	1	1	6	-23	
제 국	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	1.84	1.84	1.84	1.84	1.84	1.84	0	0	0	-56	
	G/B(10Y)	2.84	2.56	2.15	2.17	2.15	2.15	2.15	2.15	2.15	2.15	2.15	0	0	0	-40	
환 율 ²⁾	DXY	103.52	101.33	104.10	101.70	100.78	102.52	101.19	101.68	101.99	102.52	102.54	0.02	0.02	1.74	1.19	
	EURUSD	1.0705	1.1039	1.0826	1.1048	1.1135	1.0974	1.1068	1.1045	1.1031	1.0974	1.0976	0.02	0.02	-1.43	-0.57	
	USDJPY	131.12	141.04	149.98	146.17	143.63	148.70	143.57	146.47	146.93	148.70	148.18	0.35	0.35	-3.07	-4.82	
	GBPUSD	1.2083	1.2731	1.2856	1.3127	1.3375	1.3122	1.3286	1.3268	1.3124	1.3122	1.3083	-0.30	-0.30	-2.18	2.76	
	USDCAD	1.3554	1.3243	1.3808	1.3492	1.3525	1.3576	1.3490	1.3502	1.3555	1.3576	1.3620	-0.32	-0.32	-0.70	-2.77	
	AUDUSD	0.6813	0.6812	0.6542	0.6765	0.6913	0.6795	0.6883	0.6885	0.6840	0.6795	0.6757	-0.56	-0.56	-2.26	-0.81	
	USDCHF	0.9245	0.8414	0.8780	0.8496	0.8456	0.8584	0.8466	0.8497	0.8529	0.8584	0.8545	0.46	0.46	-1.04	-1.53	
	USDCNY	6.8986	7.1000	7.2267	7.0913	7.0187	7.0187	7.0187	7.0187	7.0187	7.0187	7.0187	0.00	0.00	0.00	1.16	
	SDRUSD	1.3308	1.3447	1.3284	1.3466	1.3564	1.3442	1.3505	1.3484	1.3447	1.3442	1.3397	0.34	0.34	1.25	0.38	
	EURJPY	140.36	155.69	162.37	161.49	159.93	163.18	158.90	161.78	162.08	163.18	162.64	0.33	0.33	-1.67	-4.27	
L I B O R ³⁾	USD(3M)	4.7673	5.5930	5.5027	5.2782	4.8537	4.8537	4.8537	4.8537	4.8537	4.8537	4.8537	-	0.00	0.00	0.00	-73.93
	USD(6M)	5.1389	5.5860	5.5038	5.1370	4.6821	4.6821	4.6821	4.6821	4.6821	4.6821	4.6821	-	0.00	0.00	0.00	-90.39
	Euribor(3M) ⁴⁾	2.1320	3.9090	3.6470	3.4900	3.2790	3.2500	3.2520	3.2460	3.2380	3.2500	3.2680	3.2680	1.80	1.80	-1.10	-64.10
	JPY(3M)	-0.0262	-0.0070	0.0847	0.1313	0.1789	0.1874	0.1826	0.1842	0.1858	0.1874	-	-	0.16	0.00	0.85	19.45
	GBP(3M)	3.8740	5.3246	5.3524	5.2785	5.1987	5.1822	5.1959	5.1919	5.1849	5.1822	-	-	-0.27	0.00	-1.65	-14.24
주 가	미국(DJIA)	33,147	37,690	40,843	41,563	42,330	42,353	42,157	42,197	42,012	42,353	41,954	-0.94	-0.94	-0.89	11.32	
	미국(Nasdaq)	10,466	15,011	17,599	17,714	18,189	18,138	17,910	17,925	17,918	18,138	17,924	-1.18	-1.18	-1.46	19.40	
	독일(DAX)	13,924	16,752	18,509	18,907	19,325	19,121	19,213	19,165	19,015	19,121	19,104	-0.09	-0.09	-1.14	14.04	
	일본(Nikkei)	26,095	33,464	39,102	38,648	37,920	38,636	38,652	37,809	38,552	38,636	39,333	1.80	1.80	3.73	17.54	
	중국(Shanghai)	3,089	2,975	2,939	2,842	3,336	3,336	3,336	3,336	3,336	3,336	3,336	0.00	0.00	0.00	12.15	
상 품	유가(WTI) ⁵⁾	80.3	71.7	77.9	73.6	68.2	74.4	69.8	70.1	73.7	74.4	77.1	3.71	3.71	13.16	7.66	
	유가(Dubai) ⁵⁾	78.7	76.5	79.5	77.1	72.5	77.8	69.6	75.4	74.6	77.8	79.5	2.09	2.09	9.54	3.84	
	금(U\$/oz)	1,824	2,063	2,448	2,503	2,635	2,654	2,663	2,659	2,656	2,654	2,643	-0.41	-0.41	0.30	28.10	

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