

금리 및 환율 동향

(2024. 9. 23. - 2024. 9. 27.)

(운용전략팀)한국은행

		22년말	23년말	6월말	7월말	8월말	전주말	9/23	9/24	9/25	9/26	9/27	전일비 ⁶⁾	전주말비 ⁶⁾	전월말비 ⁶⁾	전년말비 ⁶⁾
미	Fed Funds ¹⁾	4.33	5.33	5.33	5.33	5.33	4.83	4.83	4.83	4.83	4.83	-	0	0	-50	-50
	C/D(3M)	4.58	5.35	5.39	5.29	5.07	4.68	4.69	4.70	4.69	4.62	4.69	8	1	-38	-66
	T/B(3M)	4.34	5.33	5.35	5.28	5.11	4.65	4.61	4.60	4.61	4.61	4.60	-1	-5	-51	-73
	T/B(6M)	4.75	5.25	5.32	5.09	4.86	4.46	4.44	4.37	4.38	4.40	4.38	-2	-8	-47	-86
	T/N(2Y)	4.43	4.25	4.75	4.26	3.92	3.59	3.59	3.54	3.56	3.63	3.56	-7	-3	-36	-69
	T/N(5Y)	4.00	3.85	4.38	3.91	3.70	3.50	3.51	3.47	3.53	3.57	3.51	-6	1	-20	-34
	T/N(10Y)	3.87	3.88	4.40	4.03	3.90	3.74	3.75	3.73	3.78	3.80	3.75	-5	1	-15	-13
T/B(30Y)	3.96	4.03	4.56	4.30	4.20	4.08	4.09	4.08	4.14	4.13	4.10	-3	2	-9	8	
캐	G/B(2Y)	2.76	2.40	2.83	2.53	2.39	2.23	2.15	2.10	2.12	2.13	2.08	-5	-15	-32	-33
	G/B(5Y)	2.58	1.95	2.48	2.23	2.19	2.07	2.00	1.97	2.00	2.01	1.95	-6	-12	-24	0
	G/B(10Y)	2.57	2.02	2.50	2.30	2.30	2.21	2.16	2.15	2.18	2.18	2.13	-5	-8	-17	11
영	G/B(2Y)	3.58	3.98	4.22	3.83	4.11	3.93	3.92	3.92	3.96	3.96	3.94	-2	2	-17	-4
	G/B(5Y)	3.62	3.46	4.02	3.77	3.91	3.74	3.75	3.77	3.84	3.85	3.82	-3	8	-9	36
	G/B(10Y)	3.67	3.54	4.17	3.97	4.02	3.90	3.92	3.94	3.99	4.01	3.98	-3	7	-4	44
	G/B(30Y)	3.96	4.14	4.66	4.54	4.53	4.47	4.50	4.52	4.57	4.60	4.58	-2	11	4	43
프	G/B(2Y)	0.04	0.05	0.37	0.46	0.37	0.39	0.39	0.35	0.35	0.35	0.37	2	-2	-1	31
	G/B(5Y)	0.23	0.21	0.59	0.67	0.51	0.50	0.50	0.47	0.47	0.47	0.50	3	0	-1	29
	G/B(10Y)	0.42	0.61	1.06	1.06	0.90	0.85	0.85	0.82	0.82	0.83	0.85	2	0	-4	24
캐	G/B(2Y)	4.05	3.89	4.00	3.45	3.33	2.93	2.92	2.90	2.96	2.98	2.91	-7	-2	-42	-98
	G/B(5Y)	3.41	3.18	3.51	3.09	3.04	2.75	2.74	2.74	2.79	2.81	2.74	-7	-1	-30	-44
	G/B(10Y)	3.30	3.11	3.50	3.16	3.16	2.95	2.95	2.96	3.01	3.02	2.96	-6	0	-20	-15
주	G/B(2Y)	3.40	3.71	4.16	3.88	3.67	3.62	3.66	3.55	3.58	3.61	3.63	3	1	-4	-8
	G/B(5Y)	3.68	3.64	4.07	3.78	3.59	3.54	3.58	3.48	3.51	3.55	3.57	2	3	-2	-7
	G/B(10Y)	4.05	3.96	4.31	4.12	3.97	3.92	3.96	3.89	3.91	3.94	3.96	2	4	-1	0
스	G/B(2Y)	1.27	1.11	0.80	0.66	0.59	0.58	0.53	0.49	0.48	0.45	0.47	2	-11	-12	-64
	G/B(5Y)	1.47	0.80	0.67	0.53	0.52	0.54	0.48	0.44	0.45	0.41	0.41	-1	-14	-11	-40
	G/B(10Y)	1.62	0.70	0.60	0.45	0.48	0.52	0.49	0.47	0.47	0.45	0.41	-4	-11	-6	-29
캐	G/B(3Y)	2.40	2.29	1.80	1.71	1.67	1.50	1.50	1.52	1.50	1.51	1.56	5	7	-10	-72
	G/B(5Y)	2.64	2.40	1.98	1.85	1.85	1.73	1.73	1.75	1.70	1.73	1.83	10	10	-2	-57
	G/B(10Y)	2.84	2.56	2.21	2.15	2.17	2.04	2.04	2.07	2.04	2.08	2.17	9	13	0	-38
환	DXY	103.52	101.33	105.87	104.10	101.70	100.72	100.85	100.47	100.91	100.56	100.38	-0.18	-0.34	-1.30	-0.94
	EURUSD	1.0705	1.1039	1.0713	1.0826	1.1048	1.1162	1.1111	1.1180	1.1133	1.1177	1.1162	-0.13	0.00	1.03	1.11
	USDJPY	131.12	141.04	160.88	149.98	146.17	143.85	143.61	143.23	144.75	144.81	142.21	1.83	1.15	2.78	-0.82
	GBPUSD	1.2083	1.2731	1.2645	1.2856	1.3127	1.3321	1.3347	1.3413	1.3424	1.3415	1.3374	-0.31	0.40	1.88	5.05
	USDCAD	1.3554	1.3243	1.3679	1.3808	1.3492	1.3569	1.3541	1.3431	1.3485	1.3465	1.3516	-0.38	0.39	-0.18	-2.02
	AUDUSD	0.6813	0.6812	0.6670	0.6542	0.6765	0.6807	0.6838	0.6892	0.6823	0.6896	0.6903	0.10	1.41	2.04	1.34
	USDCHF	0.9245	0.8414	0.8988	0.8780	0.8496	0.8500	0.8475	0.8433	0.8504	0.8462	0.8406	0.67	1.12	1.07	0.10
	USDCNY	6.8986	7.1000	7.2673	7.2267	7.0913	7.0470	7.0521	7.0318	7.0338	7.0111	7.0111	0.00	0.51	1.14	1.27
	SDRUSD	1.3308	1.3447	1.3153	1.3284	1.3466	1.3518	1.3507	1.3520	1.3541	1.3536	1.3550	-0.10	-0.24	-0.62	-0.76
	EURJPY	140.36	155.69	172.35	162.37	161.49	160.57	159.57	160.13	161.15	161.85	158.73	1.97	1.15	1.73	-1.92
LIBOR ³⁾	USD(3M)	4.7673	5.5930	5.5862	5.5027	5.2782	4.9529	4.9296	4.9204	4.9048	4.8653	4.8550	-1.03	-9.79	-42.33	-73.80
	USD(6M)	5.1389	5.5860	5.6830	5.5038	5.1370	4.7797	4.7620	4.7379	4.7147	4.6735	4.6901	1.66	-8.95	-44.69	-89.59
	Euribor(3M) ⁴⁾	2.1320	3.9090	3.7110	3.6470	3.4900	3.4360	3.4310	3.4020	3.3520	3.3450	3.3260	-1.90	-11.00	-16.40	-58.30
	JPY(3M)	-0.0262	-0.0070	0.0844	0.0847	0.1313	0.1651	0.1687	0.1715	0.1730	0.1746	0.1762	0.16	1.11	4.49	18.32
주	미국(DJIA)	33,147	37,690	39,119	40,843	41,563	42,063	42,125	42,208	41,915	42,175	42,313	0.33	0.59	1.80	12.27
	미국(Nasdaq)	10,466	15,011	17,733	17,599	17,714	17,948	17,974	18,075	18,082	18,190	18,120	-0.39	0.95	2.29	20.71
	독일(DAX)	13,924	16,752	18,235	18,509	18,907	18,720	18,847	18,997	18,919	19,238	19,474	1.22	4.03	3.00	16.25
	일본(Nikkei)	26,095	33,464	39,583	39,102	38,648	37,724	37,724	37,941	37,870	38,926	39,830	2.32	5.58	3.06	19.02
	중국(Shanghai)	3,089	2,975	2,967	2,939	2,842	2,737	2,749	2,863	2,896	3,001	3,088	2.88	12.81	8.63	3.78
상품	유가(WTI) ⁵⁾	80.3	71.7	81.5	77.9	73.6	71.9	71.2	72.3	70.3	67.7	68.2	0.75	-5.20	-7.30	-4.84
	유가(Dubai) ⁵⁾	78.7	76.5	84.9	79.5	77.1	74.9	74.4	75.3	74.7	71.5	71.3	-0.24	-4.82	-7.51	-6.77
	금(US\$/oz)	1,824	2,063	2,327	2,448	2,503	2,622	2,629	2,657	2,657	2,672	2,658	-0.53	1.39	6.19	28.85

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