

# 금리 및 환율 동향

## (2024. 7. 12. - 2024. 7. 18.)

(운용전략팀)한국은행

		22년말	23년말	4월말	5월말	6월말	전주말	7/12	7/15	7/16	7/17	7/18	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	5.33	5.33	5.33	5.33	5.33	5.33	-	0	0	0	0
	C/D(3M)	4.58	5.35	5.38	5.39	5.39	5.35	5.35	5.33	5.30	5.33	5.31	-1	-4	-8	-4
	T/B(3M)	4.34	5.33	5.39	5.40	5.35	5.33	5.33	5.33	5.33	5.33	5.33	0	0	-2	0
	T/B(6M)	4.75	5.25	5.39	5.38	5.32	5.18	5.18	5.18	5.18	5.19	5.19	0	1	-14	-6
	T/N(2Y)	4.43	4.25	5.04	4.87	4.75	4.45	4.45	4.46	4.42	4.44	4.47	3	2	-28	22
	T/N(5Y)	4.00	3.85	4.72	4.51	4.38	4.10	4.10	4.13	4.07	4.08	4.12	4	2	-26	27
	T/N(10Y)	3.87	3.88	4.68	4.50	4.40	4.18	4.18	4.23	4.16	4.16	4.20	4	2	-19	32
	T/B(30Y)	3.96	4.03	4.78	4.65	4.56	4.40	4.40	4.46	4.37	4.37	4.42	5	3	-14	39
내 국	G/B(2Y)	2.76	2.40	3.03	3.10	2.83	2.82	2.82	2.80	2.76	2.78	2.77	-1	-6	-7	36
	G/B(5Y)	2.58	1.95	2.62	2.71	2.48	2.48	2.48	2.45	2.39	2.40	2.39	0	-8	-9	45
	G/B(10Y)	2.57	2.02	2.58	2.66	2.50	2.50	2.50	2.47	2.43	2.42	2.43	1	-6	-7	41
영 국	G/B(2Y)	3.58	3.98	4.51	4.41	4.22	4.09	4.09	4.07	3.99	4.02	3.98	-3	-10	-24	0
	G/B(5Y)	3.62	3.46	4.25	4.21	4.02	3.95	3.95	3.94	3.89	3.92	3.89	-2	-6	-13	43
	G/B(10Y)	3.67	3.54	4.35	4.32	4.17	4.11	4.11	4.10	4.05	4.08	4.06	-1	-4	-11	53
	G/B(30Y)	3.96	4.14	4.79	4.76	4.66	4.62	4.62	4.61	4.55	4.57	4.57	0	-5	-9	42
프 랑스	G/B(2Y)	0.04	0.05	0.29	0.41	0.37	0.34	0.34	0.34	0.32	0.33	0.34	1	1	-2	29
	G/B(5Y)	0.23	0.21	0.48	0.65	0.59	0.60	0.60	0.60	0.57	0.58	0.59	1	-1	0	38
	G/B(10Y)	0.42	0.61	0.88	1.07	1.06	1.07	1.07	1.07	1.03	1.04	1.04	0	-2	-1	43
캐 나 다	G/B(2Y)	4.05	3.89	4.35	4.18	4.00	3.83	3.83	3.80	3.77	3.79	3.71	-8	-12	-29	-18
	G/B(5Y)	3.41	3.18	3.87	3.68	3.51	3.37	3.37	3.37	3.32	3.32	3.35	3	-2	-17	17
	G/B(10Y)	3.30	3.11	3.82	3.63	3.50	3.41	3.41	3.42	3.35	3.35	3.38	3	-3	-12	27
호 주	G/B(2Y)	3.40	3.71	4.10	4.12	4.16	4.15	4.15	4.14	4.08	4.08	4.10	2	-5	-6	39
	G/B(5Y)	3.68	3.64	4.10	4.10	4.07	4.06	4.06	4.05	3.98	3.97	3.98	1	-7	-9	35
	G/B(10Y)	4.05	3.96	4.42	4.41	4.31	4.32	4.32	4.32	4.25	4.25	4.24	-1	-9	-7	28
스 위 스	G/B(2Y)	1.27	1.11	0.94	1.14	0.80	0.78	0.78	0.76	0.75	0.73	0.74	0	-5	-7	-37
	G/B(5Y)	1.47	0.80	0.82	1.04	0.67	0.69	0.69	0.66	0.64	0.64	0.64	0	-5	-3	-17
	G/B(10Y)	1.62	0.70	0.77	0.93	0.60	0.63	0.63	0.60	0.58	0.55	0.56	1	-7	-4	-14
제 국	G/B(3Y)	2.40	2.29	1.98	1.94	1.80	1.82	1.82	1.82	1.82	1.82	1.82	0	0	2	-47
	G/B(5Y)	2.64	2.40	2.15	2.09	1.98	2.00	2.00	1.99	1.98	1.96	1.96	0	-4	-2	-44
	G/B(10Y)	2.84	2.56	2.30	2.29	2.21	2.26	2.26	2.25	2.26	2.26	2.27	1	1	6	-29
환 율 <sup>2)</sup>	DXY	103.52	101.33	106.22	104.67	105.87	104.09	104.09	104.19	104.27	103.75	104.17	0.41	0.08	-1.60	2.80
	EURUSD	1.0705	1.1039	1.0666	1.0848	1.0713	1.0907	1.0907	1.0894	1.0899	1.0939	1.0897	-0.38	-0.09	1.72	-1.29
	USDJPY	131.12	141.04	157.80	157.31	160.88	157.83	157.83	158.06	158.35	156.20	157.37	-0.74	0.29	2.23	-10.38
	GBPUSD	1.2083	1.2731	1.2492	1.2742	1.2645	1.2988	1.2988	1.2968	1.2974	1.3009	1.2944	-0.50	-0.34	2.36	1.67
	USDCAD	1.3554	1.3243	1.3778	1.3628	1.3679	1.3635	1.3635	1.3683	1.3673	1.3683	1.3706	-0.17	-0.52	-0.20	-3.38
	AUDUSD	0.6813	0.6812	0.6473	0.6653	0.6670	0.6784	0.6784	0.6760	0.6734	0.6729	0.6706	-0.34	-1.15	0.54	-1.56
	USDCHF	0.9245	0.8414	0.9194	0.9023	0.8988	0.8944	0.8944	0.8958	0.8937	0.8834	0.8877	-0.48	0.75	1.25	-5.22
	USDCNY	6.8986	7.1000	7.2411	7.2418	7.2673	7.2504	7.2504	7.2583	7.2685	7.2621	7.2621	0.00	-0.16	0.07	-2.23
	SDRUSD	1.3308	1.3447	1.3179	1.3235	1.3153	1.3258	1.3258	1.3273	1.3262	1.3291	1.3291	0.00	-0.25	-1.03	1.18
	EURJPY	140.36	155.69	168.31	170.65	172.35	172.15	172.15	172.19	172.59	170.87	171.49	-0.36	0.38	0.50	-9.21
L I B O R <sup>3)</sup>	USD(3M)	4.7673	5.5930	5.5898	5.6045	5.5862	5.5477	5.5477	5.5474	5.5409	5.5411	-	0.02	-0.66	-4.51	-5.19
	USD(6M)	5.1389	5.5860	5.7398	5.7425	5.6830	5.5931	5.5931	5.5788	5.5568	5.5591	-	0.23	-3.40	-12.39	-2.69
	Euribor(3M) <sup>4)</sup>	2.1320	3.9090	3.8250	3.7850	3.7110	3.6640	3.6640	3.6620	3.6740	3.6780	-	0.40	1.40	-3.30	-23.10
	JPY(3M)	-0.0262	-0.0070	0.0380	0.0649	0.0844	0.0844	0.0844	0.0844	0.0844	0.0844	0.0844	0.00	0.00	0.01	9.15
	GBP(3M)	3.8740	5.3246	5.3434	5.3475	5.3513	5.3521	5.3521	5.3522	5.3522	5.3523	5.3523	0.00	0.02	0.10	2.77
주 가	미국(DJIA)	33,147	37,690	37,816	38,686	39,119	40,001	40,001	40,212	40,954	41,198	40,665	-1.29	1.66	3.95	7.89
	미국(Nasdaq)	10,466	15,011	15,658	16,735	17,733	18,398	18,398	18,473	18,509	17,997	17,871	-0.70	-2.87	0.78	19.05
	독일(DAX)	13,924	16,752	17,932	18,498	18,235	18,748	18,748	18,591	18,518	18,437	18,355	-0.45	-2.10	0.65	9.57
	일본(Nikkei)	26,095	33,464	38,406	38,488	39,583	41,191	41,191	41,191	41,275	41,098	40,126	-2.36	-2.58	1.37	19.91
	중국(Shanghai)	3,089	2,975	3,105	3,087	2,967	2,971	2,971	2,974	2,976	2,963	2,977	0.48	0.20	0.33	0.07
상 품	유가(WTI) <sup>5)</sup>	80.3	71.7	81.9	77.0	81.5	82.2	82.2	81.9	80.8	82.9	82.8	-0.04	0.74	1.57	15.59
	유가(Dubai) <sup>5)</sup>	78.7	76.5	87.6	82.7	84.9	86.3	86.3	85.5	84.5	83.8	84.9	1.26	-1.58	-0.01	10.95
	금(U\$/oz)	1,824	2,063	2,286	2,327	2,327	2,411	2,411	2,422	2,469	2,459	2,445	-0.56	1.40	5.09	18.52

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