

금리 및 환율 동향

(2024. 10. 4. - 2024. 10. 10.)

(운용전략팀)한국은행

		22년말	23년말	7월말	8월말	9월말	전주말	10/4	10/7	10/8	10/9	10/10	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	-	0	0	0	-50
	C/D(3M)	4.58	5.35	5.29	5.07	4.71	4.68	4.68	4.77	4.74	4.73	4.78	4	10	6	-58
	T/B(3M)	4.34	5.33	5.28	5.11	4.62	4.61	4.61	4.65	4.63	4.65	4.64	-1	3	2	-69
	T/B(6M)	4.75	5.25	5.09	4.86	4.40	4.44	4.44	4.44	4.44	4.46	4.46	-1	1	5	-79
	T/N(2Y)	4.43	4.25	4.26	3.92	3.64	3.92	3.92	4.00	3.96	4.02	3.96	-6	4	32	-29
	T/N(5Y)	4.00	3.85	3.91	3.70	3.56	3.80	3.80	3.87	3.85	3.92	3.89	-3	8	33	4
	T/N(10Y)	3.87	3.88	4.03	3.90	3.78	3.97	3.97	4.03	4.01	4.07	4.06	-1	9	28	18
	T/B(30Y)	3.96	4.03	4.30	4.20	4.12	4.25	4.25	4.30	4.29	4.34	4.36	2	11	24	33
캐 나 다	G/B(2Y)	2.76	2.40	2.53	2.39	2.07	2.20	2.20	2.25	2.23	2.26	2.23	-3	3	17	-17
	G/B(5Y)	2.58	1.95	2.23	2.19	1.95	2.07	2.07	2.12	2.10	2.13	2.11	-1	4	17	16
	G/B(10Y)	2.57	2.02	2.30	2.30	2.12	2.21	2.21	2.26	2.24	2.26	2.26	0	5	13	23
영 국	G/B(2Y)	3.58	3.98	3.83	4.11	3.98	4.14	4.14	4.22	4.19	4.19	4.19	0	5	20	20
	G/B(5Y)	3.62	3.46	3.77	3.91	3.86	4.02	4.02	4.10	4.07	4.06	4.08	2	7	22	62
	G/B(10Y)	3.67	3.54	3.97	4.02	4.00	4.13	4.13	4.21	4.18	4.18	4.21	3	8	21	67
	G/B(30Y)	3.96	4.14	4.54	4.53	4.58	4.68	4.68	4.73	4.72	4.72	4.75	3	8	17	61
프 랜 스	G/B(2Y)	0.04	0.05	0.46	0.37	0.39	0.37	0.37	0.42	0.41	0.41	0.42	1	4	2	36
	G/B(5Y)	0.23	0.21	0.67	0.51	0.51	0.50	0.50	0.55	0.55	0.55	0.57	2	7	6	36
	G/B(10Y)	0.42	0.61	1.06	0.90	0.86	0.89	0.89	0.93	0.93	0.94	0.96	2	7	10	35
스 위 스	G/B(2Y)	4.05	3.89	3.45	3.33	2.91	3.23	3.23	3.29	3.27	3.26	3.18	-8	-5	27	-71
	G/B(5Y)	3.41	3.18	3.09	3.04	2.74	3.02	3.02	3.07	3.06	3.07	3.01	-7	-1	27	-17
	G/B(10Y)	3.30	3.11	3.16	3.16	2.96	3.20	3.20	3.24	3.24	3.26	3.23	-3	3	27	12
주 일	G/B(2Y)	3.40	3.71	3.88	3.67	3.64	3.67	3.67	3.67	3.79	3.80	3.84	4	18	20	13
	G/B(5Y)	3.68	3.64	3.78	3.59	3.58	3.71	3.71	3.71	3.82	3.83	3.88	4	17	30	24
	G/B(10Y)	4.05	3.96	4.12	3.97	3.97	4.07	4.07	4.07	4.17	4.19	4.22	3	15	25	27
스 위 스	G/B(2Y)	1.27	1.11	0.66	0.59	0.44	0.49	0.49	0.47	0.48	0.51	0.51	1	3	8	-59
	G/B(5Y)	1.47	0.80	0.53	0.52	0.39	0.45	0.45	0.44	0.47	0.48	0.50	2	5	11	-30
	G/B(10Y)	1.62	0.70	0.45	0.48	0.41	0.46	0.46	0.47	0.50	0.52	0.55	4	9	14	-15
코 리 아	G/B(3Y)	2.40	2.29	1.71	1.67	1.56	1.56	1.56	1.56	1.64	1.69	1.65	-5	8	8	-64
	G/B(5Y)	2.64	2.40	1.85	1.85	1.84	1.84	1.84	1.84	1.91	1.89	1.83	-6	-1	-1	-57
	G/B(10Y)	2.84	2.56	2.15	2.17	2.15	2.15	2.15	2.15	2.19	2.18	2.14	-3	-1	-1	-41
환 율 ²⁾	DXY	103.52	101.33	104.10	101.70	100.78	102.52	102.52	102.54	102.55	102.93	102.99	0.06	0.46	2.19	1.63
	EURUSD	1.0705	1.1039	1.0826	1.1048	1.1135	1.0974	1.0974	1.0976	1.0980	1.0939	1.0934	-0.05	-0.36	-1.81	-0.95
	USDJPY	131.12	141.04	149.98	146.17	143.63	148.70	148.70	148.18	148.20	149.31	148.57	0.50	0.09	-3.33	-5.07
	GBPUSD	1.2083	1.2731	1.2856	1.3127	1.3375	1.3122	1.3122	1.3083	1.3104	1.3071	1.3059	-0.09	-0.48	-2.36	2.58
	USDCAD	1.3554	1.3243	1.3808	1.3492	1.3525	1.3576	1.3576	1.3620	1.3647	1.3711	1.3742	-0.23	-1.21	-1.58	-3.63
	AUDUSD	0.6813	0.6812	0.6542	0.6765	0.6913	0.6795	0.6795	0.6757	0.6744	0.6718	0.6739	0.31	-0.82	-2.52	-1.07
	USDCHF	0.9245	0.8414	0.8780	0.8496	0.8456	0.8584	0.8584	0.8545	0.8574	0.8608	0.8570	0.44	0.16	-1.33	-1.82
	USDCNY	6.8986	7.1000	7.2267	7.0913	7.0187	7.0187	7.0187	7.0187	7.0633	7.0808	7.0765	0.06	-0.82	-0.82	0.33
	SDRUSD	1.3308	1.3447	1.3284	1.3466	1.3564	1.3442	1.3442	1.3397	1.3415	1.3398	1.3384	0.11	0.44	1.34	0.47
	EURJPY	140.36	155.69	162.37	161.49	159.93	163.18	163.18	162.64	162.72	163.33	162.45	0.54	0.45	-1.55	-4.16
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	-	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	-	0.00	0.00	0.00	-90.39
	Euribor(3M) ⁴⁾	2.1320	3.9090	3.6470	3.4900	3.2790	3.2500	3.2500	3.2680	3.2650	3.2230	-	-4.20	-2.70	-5.60	-68.60
	JPY(3M)	-0.0262	-0.0070	0.0847	0.1313	0.1789	0.1874	0.1874	0.1900	0.1939	0.1955	0.1971	0.16	0.96	1.82	20.41
	GBP(3M)	3.8740	5.3246	5.3524	5.2785	5.1987	5.1822	5.1822	5.1794	5.1767	5.1730	5.1657	-0.73	-1.65	-3.30	-15.89
주 가	미국(DJIA)	33,147	37,690	40,843	41,563	42,330	42,353	42,353	41,954	42,080	42,512	42,454	-0.14	0.24	0.29	12.64
	미국(Nasdaq)	10,466	15,011	17,599	17,714	18,189	18,138	18,138	17,924	18,183	18,292	18,282	-0.05	0.80	0.51	21.79
	독일(DAX)	13,924	16,752	18,509	18,907	19,325	19,121	19,121	19,104	19,066	19,255	19,211	-0.23	0.47	-0.59	14.68
	일본(Nikkei)	26,095	33,464	39,102	38,648	37,920	38,636	38,636	39,333	38,938	39,278	39,381	0.26	1.93	3.85	17.68
	중국(Shanghai)	3,089	2,975	2,939	2,842	3,336	3,336	3,336	3,336	3,490	3,259	3,302	1.32	-1.04	-1.04	10.99
상 품	유가(WTI) ⁵⁾	80.3	71.7	77.9	73.6	68.2	74.4	74.4	77.1	73.6	73.2	75.9	3.56	1.98	11.27	5.86
	유가(Dubai) ⁵⁾	78.7	76.5	79.5	77.1	72.5	77.8	77.8	79.5	79.2	77.5	77.2	-0.43	-0.81	6.42	0.89
	금(U\$/oz)	1,824	2,063	2,448	2,503	2,635	2,654	2,654	2,643	2,622	2,608	2,630	0.84	-0.90	-0.18	27.47

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