

레포 시장동향

◎ 지난주

주초 건보자금 및 공자기금 유입되어 금리 하락했고, 통안계정 증액했음에도 시장 잉여세 강해 은행 및 증권 저금리 꾸준하였음.
레포금리 콜금리를 하회하자 시은 적수 관리를 위한 매도 급증했으며, 유동성 점차 축소됨에 따라 주 중반 이후 금리 상승 전환하였음.
주말 전 공모주 청약(NH스팩31호) 환불 영향으로 시작금리 급등했으나 장 중 추가자금 유입 계속되어 수급 무난한 모습을 보임.

◎ 금일

공모주 청약(산일전기) 자금 유입으로 자금 잉여세 보일 것으로 예상되며, 은행권 매도 규모에 따라 수급 달라질 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.07.19 (금)				2024.07.22 (월)					
국고채 조기환매		20,000		공자기금		4,000			
재정 및 기타		11,000		재정 및 기타		14,000			
공자기금 환수		-7,000		세입 및 기타		-13,000			
세입 및 기타		-8,000							
기타		-1,000							
전일 기준	지준	30,156	적수	-44,721	금일 예상	지준	35,000	적수	51,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.07.15(월)	207.1	205.8	3.48%	3.509%	3.501%	3.500%	3.54%	3.076%	3.103%
2024.07.16(화)	214.3	209.4	3.40%	3.483%	3.426%		3.55%	3.035%	3.061%
2024.07.17(수)	217.5	211.5	3.45%	3.517%	3.473%		3.54%	3.050%	3.072%
2024.07.18(목)	213.8	210.4	3.50%	3.523%	3.519%		3.52%	3.058%	3.081%
2024.07.19(금)	209.6		3.57%	3.564%	3.583%		3.52%	3.074%	3.099%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2024.07.11(목)	3.50% (동결)	2024.02.22(목)	3.50% (동결)	2023.10.19(목)	3.50% (동결)	2023.05.25(목)	3.50% (동결)	2023.01.13(금)	3.50% (▲0.25)
2024.05.23(목)	3.50% (동결)	2024.01.11(목)	3.50% (동결)	2023.08.24(목)	3.50% (동결)	2023.04.11(화)	3.50% (동결)	2022.11.24(목)	3.25% (▲0.25)
2024.04.12(금)	3.50% (동결)	2023.11.30(목)	3.50% (동결)	2023.07.13(목)	3.50% (동결)	2023.02.23(목)	3.50% (동결)	2022.10.12(수)	3.00% (▲0.50)

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰액	금리	낙찰액	낙찰률	회차번호
2024.07.18(목)	14:00~14:10	7	2024.07.25(목)	40.27	3.50%	6.00	14.9%	2024-038-007

◎ 통화안정예금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정액	응찰금액	낙찰금리	낙찰액	회차번호
2024.06.25(화)	14:00~14:10	28	2024.07.23(화)	0.10	0.18	3.48%	0.10	2024-0024-0028
2024.07.02(화)	14:00~14:10	28	2024.07.30(화)	0.50	1.69	3.45%	0.50	2024-0025-0028
2024.07.16(화)	14:00~14:10	28	2024.08.13(화)	0.50	1.65	3.45%	0.56	2024-0026-0028
	14:30~14:40	7	2024.07.23(화)	1.00	2.77	3.48%	1.20	2024-0027-0007

청약 정보

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사/인수사(증거금)
공모주	산일전기	특수변압기 전문기업	2024.07.18(목) ~ 2024.07.19(금)	2024.07.23(화)	미래(16.35조), 삼성(5,335억) 16.4조
실권주	켈리타스반도체	IP(설계자산) 개발 전문기업	2024.07.18(목) ~ 2024.07.19(금)	2024.07.23(화)	NH(379억)
공모주	피앤에스미캐닉스	의료용 재활로봇 전문기업	2024.07.22(월) ~ 2024.07.23(화)	2024.07.25(목)	키움
실권주	휴림로봇	산업용 로봇 및 자동화 장비 기업	2024.07.24(수) ~ 2024.07.25(목)	2024.07.29(월)	SK
공모주	아이비테크놀로지	고성능 의과학 현미경 제조 기업	2024.07.25(목) ~ 2024.07.26(금)	2024.07.30(화)	삼성
실권주	자연과환경	자연생태복원 기업	2024.07.25(목) ~ 2024.07.26(금)	2024.07.30(화)	SK

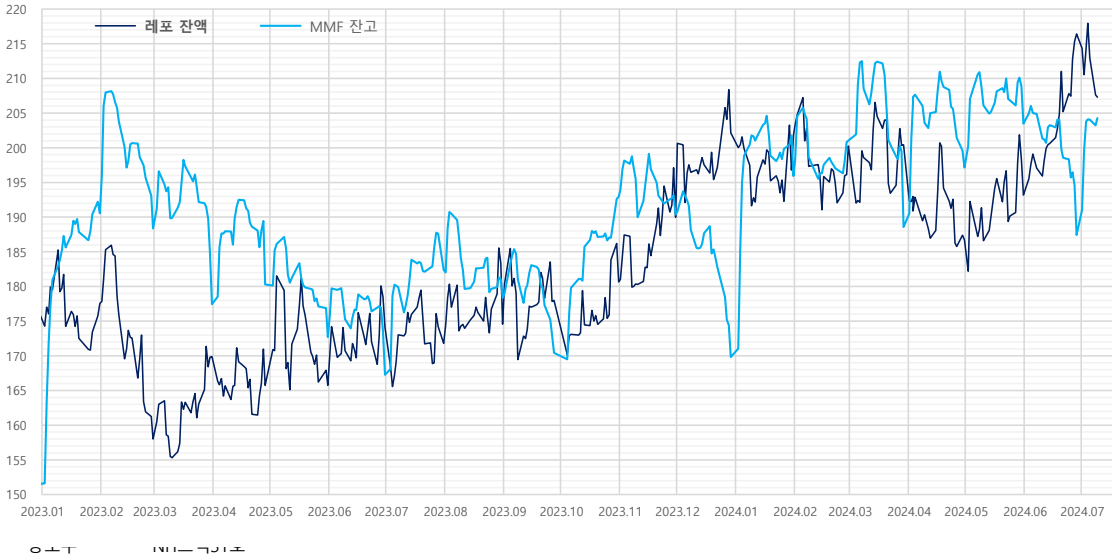
관련 정보

지준일	2024.08.07(수)	금통위	2024.08.22(목)	FOMC	2024.07.30(화) ~ 2024.07.31(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24)	www.kcmi.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&zcd=002001016&zno=1792&cno=6356					경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttid=10084595&menuNo=200295					무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10082072&menuNo=200690					증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10078655&menuNo=200690					금융투자협회	https://kofiabond.or.kr

지준 계산·적립기간, 금통위 및 FOMC

	지준 계산기간		지준 적립기간		금통위			FOMC
	시작일	마감일	시작일	마감일	통화정책방향 결정회의	정기회의	금융안정회의	
2024년 1월	01.01(월)	01.31(수)	02.08(목)	03.06(수)	01.11(목)	01.25(목)		01.30(화) ~ 01.31(수)
2024년 2월	02.01(목)	02.29(목)	03.07(목)	04.10(수)	02.22(목)	02.08(목)		
2024년 3월	03.01(금)	03.31(일)	04.11(목)	05.08(수)		03.14(목)	03.28(목)	03.19(화) ~ 03.20(수)
2024년 4월	04.01(월)	04.30(화)	05.09(목)	06.05(수)	04.12(금)	04.25(목)		04.30(화) ~ 05.01(수)
2024년 5월	05.01(수)	05.31(금)	06.06(목)	07.10(수)	05.23(목)	05.09(목)		
2024년 6월	06.01(토)	06.30(일)	07.11(목)	08.07(수)		06.13(목)	06.26(수)	06.11(화) ~ 06.12(수)
2024년 7월	07.01(월)	07.31(수)	08.08(목)	09.11(수)	07.11(목)	07.18(목)		07.30(화) ~ 07.31(수)
2024년 8월	08.01(목)	08.31(토)	09.12(목)	10.09(수)	08.22(목)	08.08(목)		
2024년 9월	09.01(일)	09.30(월)	10.10(목)	11.06(수)		09.12(목)	09.26(목)	09.17(화) ~ 09.18(수)
2024년 10월	10.01(화)	10.31(목)	11.07(목)	12.11(수)	10.11(금)	10.31(목)		
2024년 11월	11.01(금)	11.30(토)	12.12(목)	2025.01.08(수)	11.28(목)	11.14(목)		11.06(수) ~ 11.07(목)
2024년 12월	12.01(일)	12.31(화)	2025.01.09(목)	2025.02.05(수)		12.12(목)	12.24(화)	12.17(화) ~ 12.18(수)

레포 거래잔액 및 MMF 잔고 추이

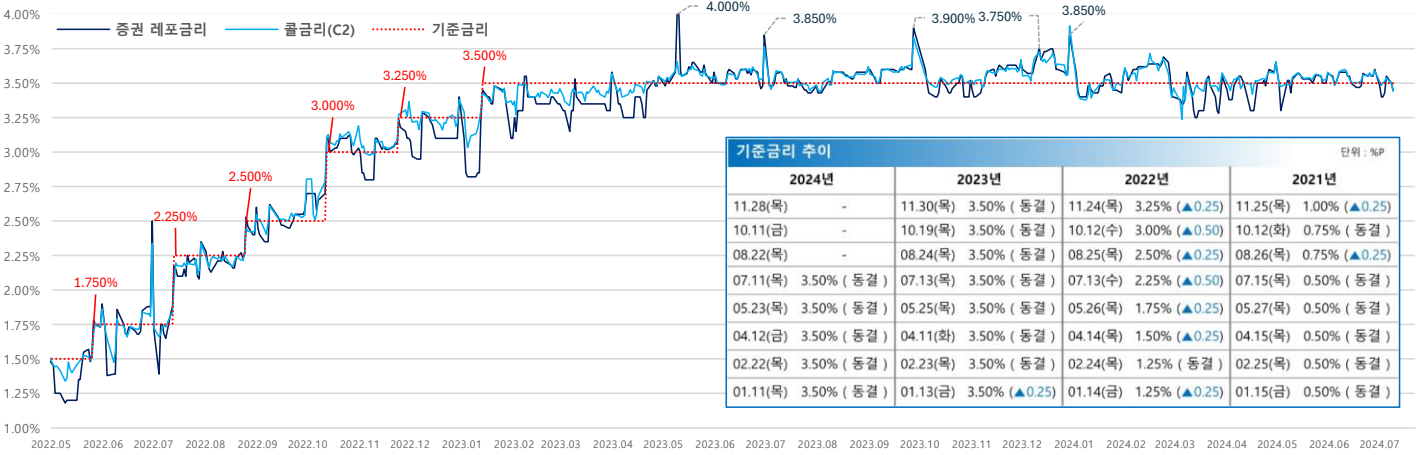


단위 : 조 원

해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전월대비	전월대비
2024.06.28	187.4	-7.1	-16.1
2024.05.31	203.5	-5.4	6.3
2024.04.30	197.1	-2.4	8.5
2024.03.29	188.6	-10.9	-12.4
2024.02.29	201.0	0.2	5.1
2024.01.31	195.9	-5.8	26.1
2023.12.29	169.8	-4.6	-20.6
2023.11.30	190.4	-2.8	-2.5
2023.10.31	192.9	0.3	22.5
2023.09.27	170.4	-2.6	-7.9
2023.08.31	178.3	-2.7	-4.0
2023.07.31	182.4	-5.2	15.1
2023.06.30	167.3	-6.3	-5.4
2023.05.31	172.7	-4.2	-7.6
2023.04.28	180.3	-9.1	2.9
2023.03.31	177.4	-7.4	-10.9
2023.02.28	188.4	-4.7	-2.2
2023.01.31	190.6	-1.6	39.0
2022.12.30	151.5	-5.6	-3.3
2022.11.30	154.8	-3.4	6.3
2022.10.31	148.5	-3.1	6.4
2022.09.30	142.1	-6.4	-10.9
2022.08.31	153.0	-3.7	-0.6
2022.07.29	153.6	-5.2	7.4
2022.06.30	146.2	-5.5	-10.5
2022.05.31	156.6	-1.7	-6.7
2022.04.29	163.4	-6.1	10.4
2022.03.31	153.0	-5.7	-1.2
2022.02.28	154.2	-6.6	-3.8
2022.01.28	158.0	3.8	22.5

자료 : 금융투자협회, 예탁결제원

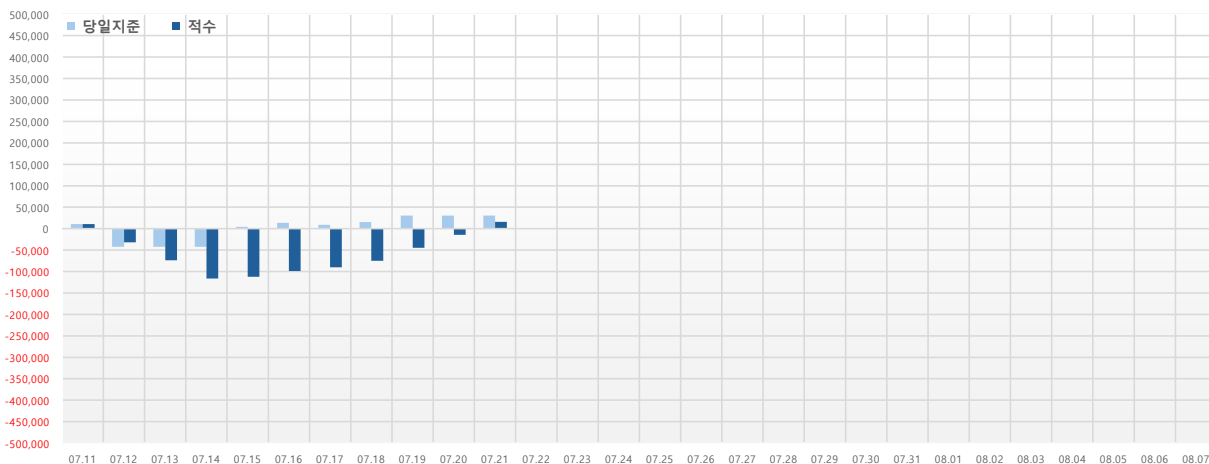
단기금융시장 금리 추이



단위 : %P

기준금리 추이			
2024년	2023년	2022년	2021년
11.28(목) -	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금) -	10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목) -	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목) 3.50% (동결)	07.13(목) 3.50% (동결)	07.13(수) 2.25% (▲0.50)	07.15(목) 0.50% (동결)
05.23(목) 3.50% (동결)	05.25(목) 3.50% (동결)	05.26(목) 1.75% (▲0.25)	05.27(목) 0.50% (동결)
04.12(금) 3.50% (동결)	04.11(화) 3.50% (동결)	04.14(목) 1.50% (▲0.25)	04.15(목) 0.50% (동결)
02.22(목) 3.50% (동결)	02.23(목) 3.50% (동결)	02.24(목) 1.25% (동결)	02.25(목) 0.50% (동결)
01.11(목) 3.50% (동결)	01.13(금) 3.50% (▲0.25)	01.14(금) 1.25% (▲0.25)	01.15(금) 0.50% (동결)

당일지준 및 적수 추이



단위 : 억 원

	당일지준	적수
07.11(목)	10,783	10,783
07.12(금)	-42,427	-31,643
07.13(토)	-42,427	-74,070
07.14(일)	-42,427	-116,497
07.15(월)	4,464	-112,029
07.16(화)	13,462	-98,576
07.17(수)	8,622	-89,953
07.18(목)	15,077	-74,875
07.19(금)	30,156	-44,721
07.20(토)	30,156	-14,565
07.21(일)	30,156	15,591
07.22(월)		
07.23(화)		
07.24(수)		
07.25(목)		
07.26(금)		
07.27(토)		
07.28(일)		
07.29(월)		
07.30(화)		
07.31(수)		
08.01(목)		
08.02(금)		
08.03(토)		
08.04(일)		
08.05(월)		
08.06(화)		
08.07(수)		