

레포 시장동향

◎ 지난주

주초 국고여유자금·공자기금 및 행안부 재정 유입되어 조달금리 낮게 형성됐으며, 은행 및 증권 매도 꾸준하여 잉여자금 해소 원활하였음.
주 중반까지 잉여세 지속되어 공모주(아이빔테크놀로지) 청약 환불 영향 제한적이었고, 월말일에도 유동성 풍부하여 조달여건 양호한 모습을 보임.
월초 국고여유자금 유입과 함께 MMF-MMT 설정 이어졌으나 지준 마감 불확실성 확대됨에 따라 주말 앞두고 조달금리 급등하였음.

◎ 금일

국고금 유출입 혼재한 가운데 별다른 조달여건 개선요인 없어 빠듯한 장세 지속되겠음. 은행권 조달 규모에 따라 장 중 분위기 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.08.02 (금)				2024.08.05 (월)					
국고여유자금		48,000		국고여유자금		28,000			
재정 및 기타		34,000		재정 및 기타		20,000			
월말세입 및 기타		-87,000		공자기금 환수		-30,000			
				세입 및 기타		-5,000			
전일 기준	지준	-38,366	적수	195,280	금일 예상	지준	-25,000	적수	93,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.07.29(월)	217.4	207.0	3.43%	3.505%	3.452%	3.500%	3.50%	2.978%	2.990%
2024.07.30(화)	217.7	206.7	3.45%	3.513%	3.474%		3.50%	2.994%	3.005%
2024.07.31(수)	212.9	203.1	3.50%	3.530%	3.519%		3.50%	3.004%	3.023%
2024.08.01(목)	215.0	204.7	3.45%	3.512%	3.470%		3.49%	2.976%	2.987%
2024.08.02(금)	221.7		3.52%	3.542%	3.537%		3.48%	2.939%	2.948%

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
2024.08.01(목)	14:00~14:10	7	2024.08.08(목)	31.83	3.50%	1.90	6.0%	2024-040-007

◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정액	응찰금액	낙찰금리	낙찰액	회차번호
2024.07.16(화)	14:00~14:10	28	2024.08.13(화)	0.50	1.65	3.45%	0.56	2024-0026-0028
2024.07.23(화)	14:00~14:10	28	2024.08.20(화)	0.50	0.89	3.48%	0.50	2024-0028-0028
2024.07.30(화)	14:00~14:10	28	2024.08.27(화)	0.30	0.47	3.48%	0.30	2024-0029-0028

청약 정보

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사/인수사(증거금)
공모주	뱅크웨이글로벌	금융 소프트웨어 기업	2024.08.01(목) ~ 2024.08.02(금)	2024.08.06(화)	미래(6,697억)
공모주	교보스팩16호	기업인수목적회사	2024.08.01(목) ~ 2024.08.02(금)	2024.08.06(화)	교보(9,558억)
실권주	하나마이크론	반도체 후공정 전문 기업	2024.08.01(목) ~ 2024.08.02(금)	2024.08.06(화)	대신(3,252억)
공모주	유라클	의료용 기기 및 치료제 개발 기업	2024.08.06(화) ~ 2024.08.07(수)	2024.08.09(금)	키움
실권주	셀리드	의료 백신 개발 기업	2024.08.06(화) ~ 2024.08.07(수)	2024.08.09(금)	LS, 한양
공모주	넥스트바이오메디컬	혁신형 치료제 개발 및 수출 기업	2024.08.07(수) ~ 2024.08.08(목)	2024.08.12(월)	한투
공모주	전진건설로봇	콘크리트 펌프 제조 기업	2024.08.08(목) ~ 2024.08.09(금)	2024.08.13(화)	미래
공모주	케이쓰리아이	확장현실(XR) 전문기업	2024.08.08(목) ~ 2024.08.09(금)	2024.08.13(화)	하나
공모주	티디에스팜	경피약물전달 의약품 전문기업	2024.08.09(금) ~ 2024.08.12(월)	2024.08.14(수)	한투

관련 정보

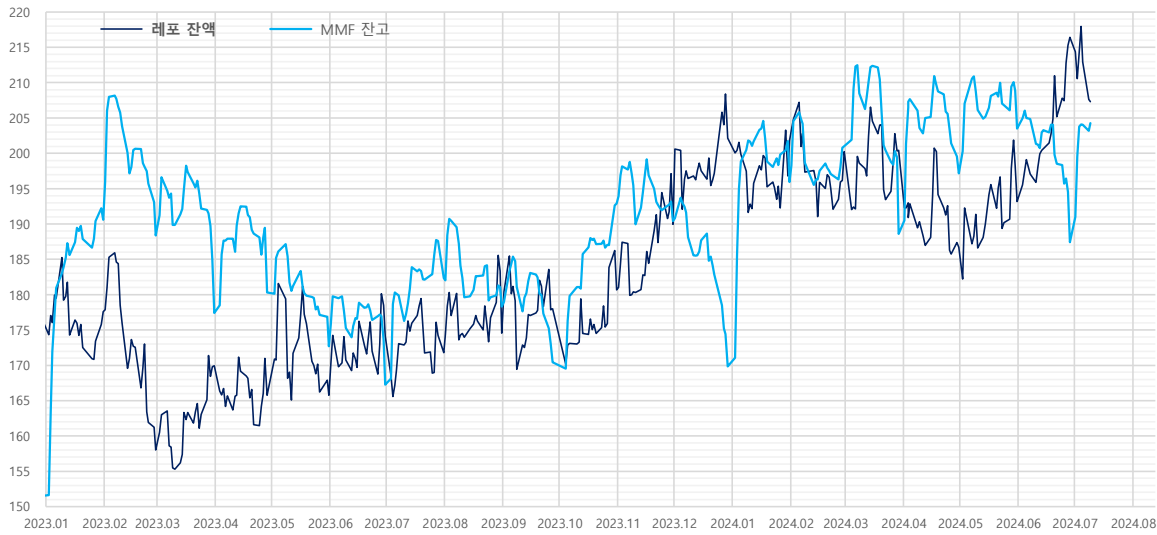
지준일	2024.08.07(수)	금통위	2024.08.22(목)	FOMC	2024.09.17(화) ~ 2024.09.18(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr		
· 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24)							www.kcmi.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&zcd=002001016&zno=1792&cno=6356	경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlid=10084595&menuNo=200295	무위험저표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=10082072&menuNo=200690	증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=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

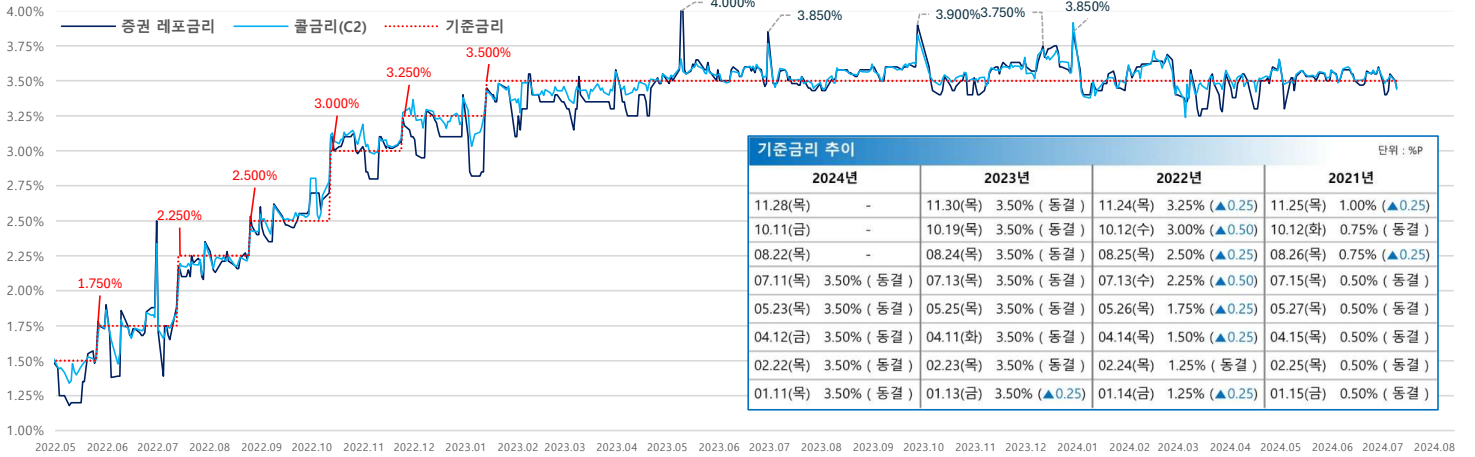
단위 : 조 원



해당연월	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, 메타결제원

단기금융시장 금리 추이

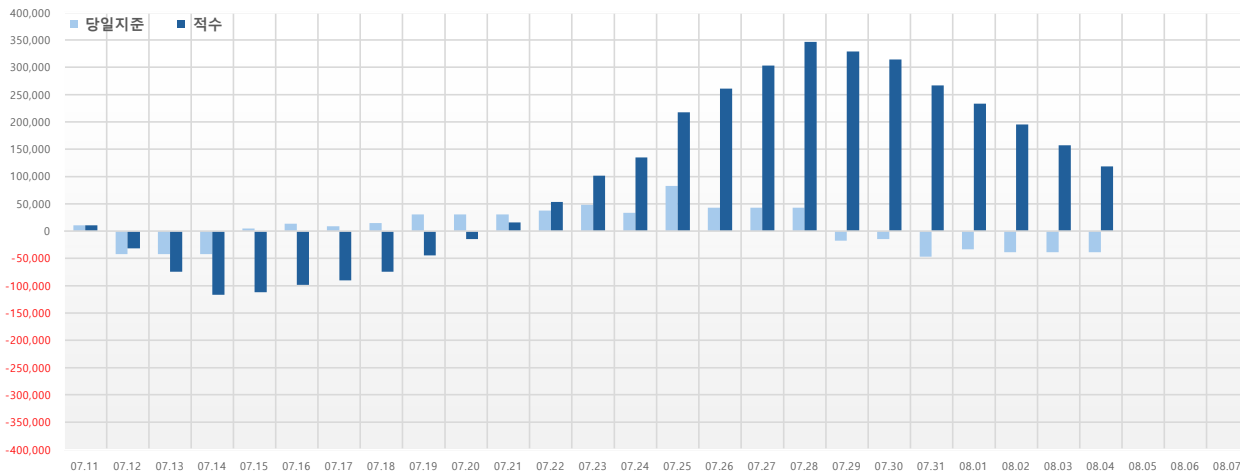


기준금리 추이				단위 : %P
2024년	2023년	2022년	2021년	
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목)	-	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% 0.75% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	3.50% (동결)	07.13(목) 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)

자료 : 한국은행

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)	37,387	53,218
07.23(화)	48,316	101,286
07.24(수)	33,823	135,110
07.25(목)	82,581	217,658
07.26(금)	42,921	260,579
07.27(토)	42,921	303,500
07.28(일)	42,921	346,421
07.29(월)	-17,571	328,848
07.30(화)	-14,800	314,060
07.31(수)	-47,093	266,962
08.01(목)	-33,216	233,645
08.02(금)	-38,366	195,280
08.03(토)	-38,366	156,914
08.04(일)	-38,366	118,548
08.05(월)		
08.06(화)		
08.07(수)		