

레포 시장동향

◎ 전일

시중은행 매도 감소하여 국고여유자금 환수 영향 제한적이었음. 공모주 청약 관련 자금 유입되어 조달여건 양호했으며, 추가 자금 일부 저금리 매칭되었음.

◎ 금일

당일기준 부족세 지속되는 가운데 연이은 국고여유자금 환수 영향으로 유동성 축소되겠음. 금리 수준에 따라 은행권 매도 가변적이겠고, 수급 다소 빠듯할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.08.08 (목)				2024.08.09 (금)				
한은RP매각 만기(7일)		19,000		재정증권 만기(63일)		20,000		
공자기금		4,000		재정 및 기타		30,000		
재정 및 기타		60,000						
한은RP매각(6일)		-5,000		국고여유자금 환수		-25,000		
통안채 발행(2년)		-21,000		세입 및 기타		-9,000		
재정증권 발행(63일)		-10,000						
국고여유자금 환수		-49,000						
새입 및 기타		-12,000						
요지준 변동		-1,000						
전일 기준	지준	-70,909	적수	금일 예상	지준	-55,000	적수	-126,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.08.02(금)	221.7	209.0	3.52%	3.542%	3.537%		3.48%	2.939%	2.948%
2024.08.05(월)	222.4	208.3	3.52%	3.545%	3.536%		3.48%	2.806%	2.817%
2024.08.06(화)	216.8	206.1	3.55%	3.535%	3.568%	3.500%	3.47%	2.935%	2.953%
2024.08.07(수)	217.4	205.2	3.55%	3.487%	3.568%		3.48%	2.929%	2.951%
2024.08.08(목)	216.0		3.53%	3.531%	3.542%		3.47%	2.911%	2.934%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

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

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰액	금리	낙찰액	낙찰률	회차번호
2024.08.08(목)	14:00~14:10	6	2024.08.14(수)	10.30	3.50%	0.50	4.9%	2024-041-006

◎ 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	넥스트바이오메디컬	혁신형 치료제 개발 및 수출 기업	2024.08.07(수) ~ 2024.08.08(목)	2024.08.12(월)	한투(2,386억)
공모주	전진건설로봇	콘크리트 펌프 제조 기업	2024.08.08(목) ~ 2024.08.09(금)	2024.08.13(화)	미래(1,506억)
공모주	케이쓰리아이	확장현실(XR) 전문기업	2024.08.08(목) ~ 2024.08.09(금)	2024.08.13(화)	하나(68억)
공모주	티디에스팜	경피약물전달 의약품 전문기업	2024.08.09(금) ~ 2024.08.12(월)	2024.08.14(수)	한투
공모주	대신밸런스스팩18호	기업인수목적회사	2024.08.09(금) ~ 2024.08.12(월)	2024.08.14(수)	대신
공모주	엠83	시각특수효과(VFX) 전문기업	2024.08.12(월) ~ 2024.08.13(화)	2024.08.16(금)	신영, 유진
공모주	이엔셀	세포유전자 치료제 및 신약 개발 전문기업	2024.08.12(월) ~ 2024.08.13(화)	2024.08.16(금)	NH
실권주	이렘	스테인리스 강관 제조기업	2024.08.12(월) ~ 2024.08.13(화)	2024.08.16(금)	한양

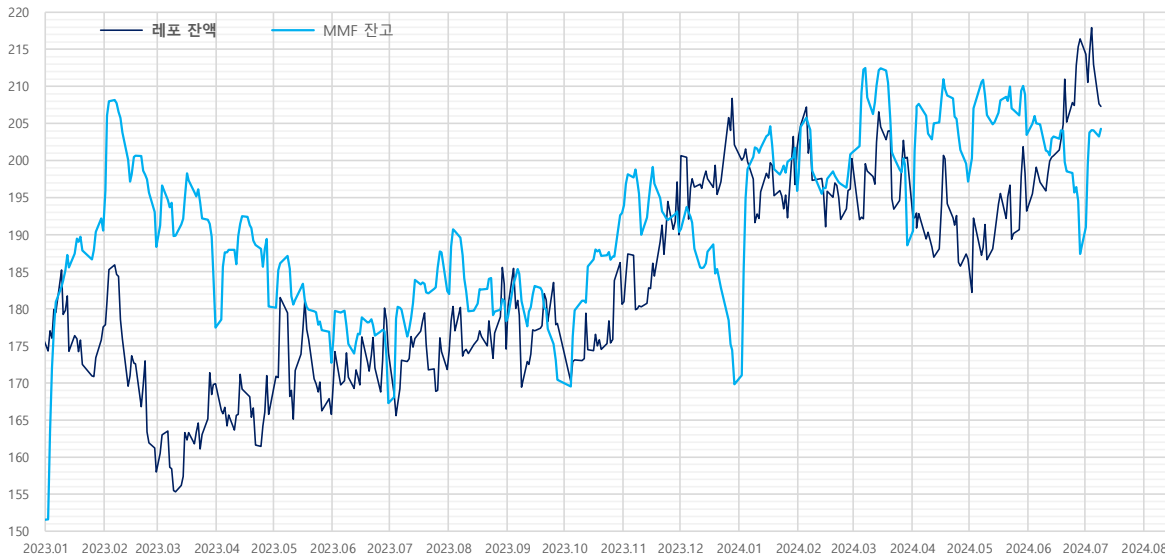
관련 정보

지준일	2024.09.11(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?nttld=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?nttld=10082072&menuNo=200690		증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=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

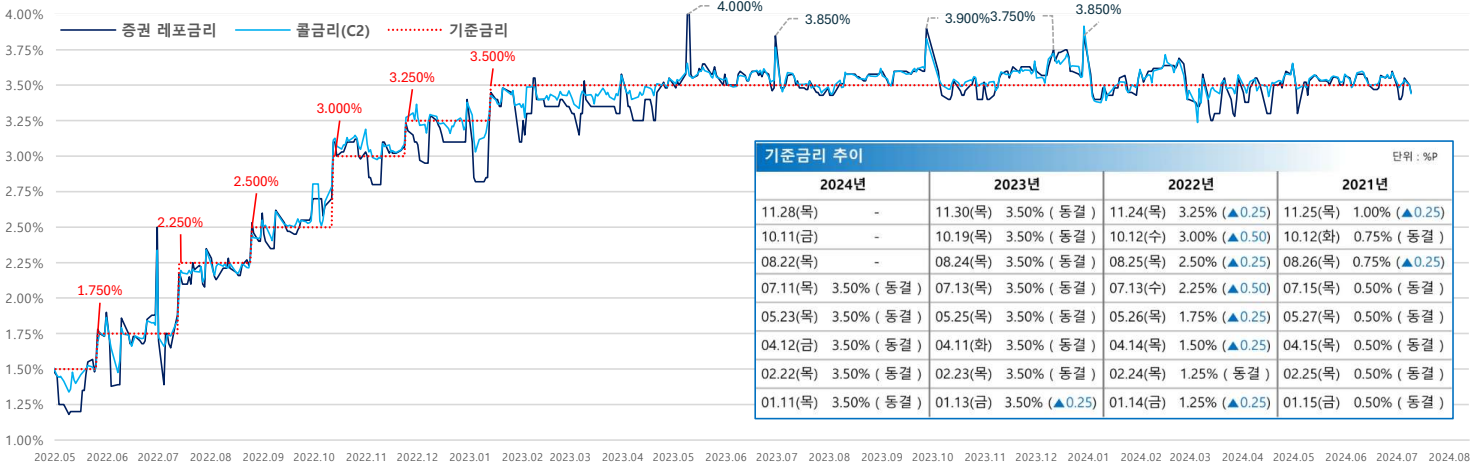


단위 : 조 원

해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	전월대비
2024.07.31	203.1	-3.7	15.6
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



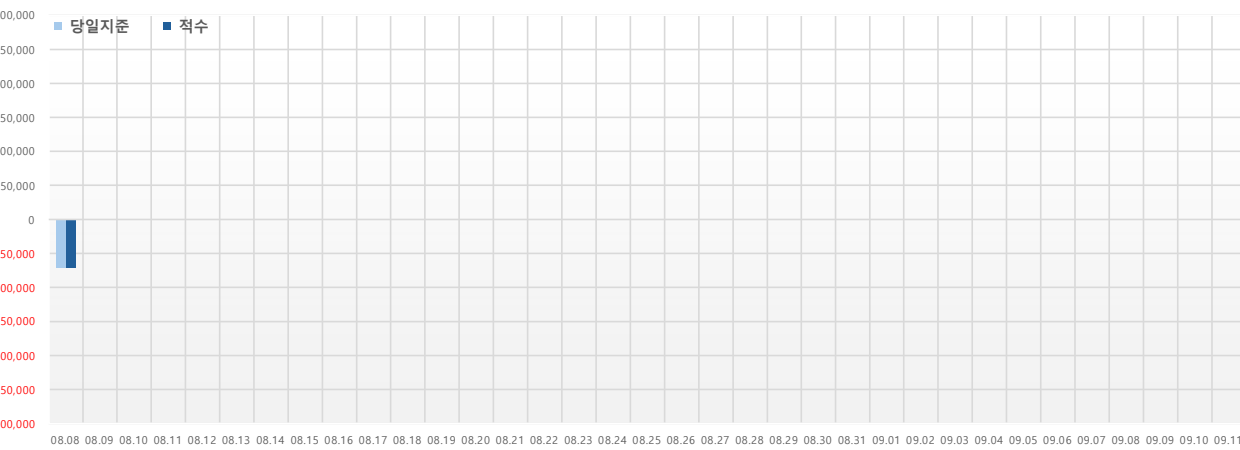
기준금리 추이

2024년				2023년				2022년				2021년			
연월	금리	동결	변동	연월	금리	동결	변동	연월	금리	동결	변동	연월	금리	동결	변동
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)	

단위 : %P

자료 : 한국은행

당일지준 및 적수 추이



단위 : 억 원

연월	당일지준	적수
08.08(목)		
08.09(금)		
08.10(토)		
08.11(일)		
08.12(월)		
08.13(화)		
08.14(수)		
08.15(목)		
08.16(금)		
08.17(토)		
08.18(일)		
08.19(월)		
08.20(화)		
08.21(수)		
08.22(목)		
08.23(금)		
08.24(토)		
08.25(일)		
08.26(월)		
08.27(화)		
08.28(수)		
08.29(목)		
08.30(금)		
08.31(토)		
09.01(일)		
09.02(월)		
09.03(화)		
09.04(수)		
09.05(목)		
09.06(금)		
09.07(토)		
09.08(일)		
09.09(월)		
09.10(화)		
09.11(수)		