

## 레포 시장동향

## ◎ 전일

건보자금 및 공자기금 유입됐음에도 금리 소폭 하락에 그쳐 시은 매도에 소극적이었음. 장 중 수급 무난했으나 추가 자금 많지 않아 저금리 거래 제한적이었음.

## ◎ 금일

건보자금 유입되어 청약 환불 영향 제한적이겠고, 조달여건 양호할 것으로 기대됨. 은행권 조달 강도에 따라 장 중 분위기 가변적일 전망.

## 지준 증감 요인

단위: 억 원

| 2024.08.14 (수) |         |                          |         | 2024.08.16 (금) |       |    |         |    |          |
|----------------|---------|--------------------------|---------|----------------|-------|----|---------|----|----------|
| 한은RP매각 만기(6일)  | 5,000   | 재정증권 만기(63일)             | 12,800  |                |       |    |         |    |          |
| 공자기금           | 16,000  | 재정 및 기타                  | 25,000  |                |       |    |         |    |          |
| 재정 및 기타        | 21,000  |                          |         |                |       |    |         |    |          |
| 한은RP매각(8일)     | -3,000  | 통안채 발행(1년), 낙찰수익률 3.000% | -7,200  |                |       |    |         |    |          |
| 국고채 발행(2년)     | -11,000 | 재정증권 발행(63일)             | -10,000 |                |       |    |         |    |          |
| 원천세 및 기타       | -95,000 | 공자기금 환수                  | -8,000  |                |       |    |         |    |          |
|                |         | 세입 및 기타                  | -5,000  |                |       |    |         |    |          |
| 전일 기준          | 지준      | -41,265                  | 적수      | -321,149       | 금일 예상 | 지준 | -34,000 | 적수 | -397,000 |

## Market Data

단위: 조 원

|               | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리  | 콜금리(C2) | KOFR   | 기준금리   | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2024.08.08(목) | 216.0   | 203.3  | 3.53% | 3.531%  | 3.542% |        | 3.47%   | 2.911%  | 2.934%  |
| 2024.08.09(금) | 215.3   | 201.2  | 3.50% | 3.531%  | 3.518% |        | 3.47%   | 2.941%  | 2.958%  |
| 2024.08.12(월) | 216.7   | 199.3  | 3.50% | 3.534%  | 3.523% | 3.500% | 3.46%   | 2.946%  | 2.954%  |
| 2024.08.13(화) | 210.9   | 197.5  | 3.57% | 3.579%  | 3.586% |        | 3.49%   | 2.918%  | 2.930%  |
| 2024.08.14(수) | 212.3   |        | 3.55% | 3.561%  | 3.564% |        | 3.49%   | 2.888%  | 2.899%  |

## 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

## ◎ RP매입

| 입찰일           | 입찰시간        | 기일 | 만기일           | 예정액  | 평균낙찰금리 | 응찰액  | 낙찰액  | 회차번호         |
|---------------|-------------|----|---------------|------|--------|------|------|--------------|
| 2024.08.13(화) | 11:20~11:30 | 7  | 2024.08.20(화) | 6.50 | 3.52%  | 8.28 | 6.50 | 2024-042-007 |

## ◎ RP매각

| 입찰일           | 입찰시간        | 기일 | 만기일           | 응찰액  | 금리    | 낙찰액  | 낙찰률  | 회차번호         |
|---------------|-------------|----|---------------|------|-------|------|------|--------------|
| 2024.08.14(수) | 14:00~14:10 | 8  | 2024.08.22(목) | 4.90 | 3.50% | 0.30 | 6.1% | 2024-043-008 |

## ◎ 통화안정계정예치금

| 입찰일           | 입찰시간        | 기일 | 만기일           | 예정액  | 응찰금액 | 낙찰금리  | 낙찰액  | 회차번호           |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 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 |
| 2024.08.13(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.09.10(화) | 0.10 | 0.26 | 3.48% | 0.10 | 2024-0030-0028 |

## 청약 정보

| 구분  | 청약명      | 업체                      | 모집일                           | 환불일           | 주간사/인수사(증거금)          |
|-----|----------|-------------------------|-------------------------------|---------------|-----------------------|
| 공모주 | 엠83      | 시각특수효과(VFX) 전문기업        | 2024.08.12(월) ~ 2024.08.13(화) | 2024.08.16(금) | 신영(1.58억), 유진(3,349억) |
| 공모주 | 이엔셀      | 세포·유전자 치료제 및 신약 개발 전문기업 | 2024.08.12(월) ~ 2024.08.13(화) | 2024.08.16(금) | NH(2.78조)             |
| 실권주 | 이렘       | 스테인리스 강관 제조기업           | 2024.08.12(월) ~ 2024.08.13(화) | 2024.08.16(금) | 한양(3억)                |
| 공모주 | 키움스팩9호   | 기업인수목적회사                | 2024.08.19(월) ~ 2024.08.20(화) | 2024.08.22(목) | 키움                    |
| 공모주 | 아이스크림미디어 | 교육 미디어 기업               | 2024.08.21(수) ~ 2024.08.22(목) | 2024.08.26(월) | 삼성                    |

## 관련 정보

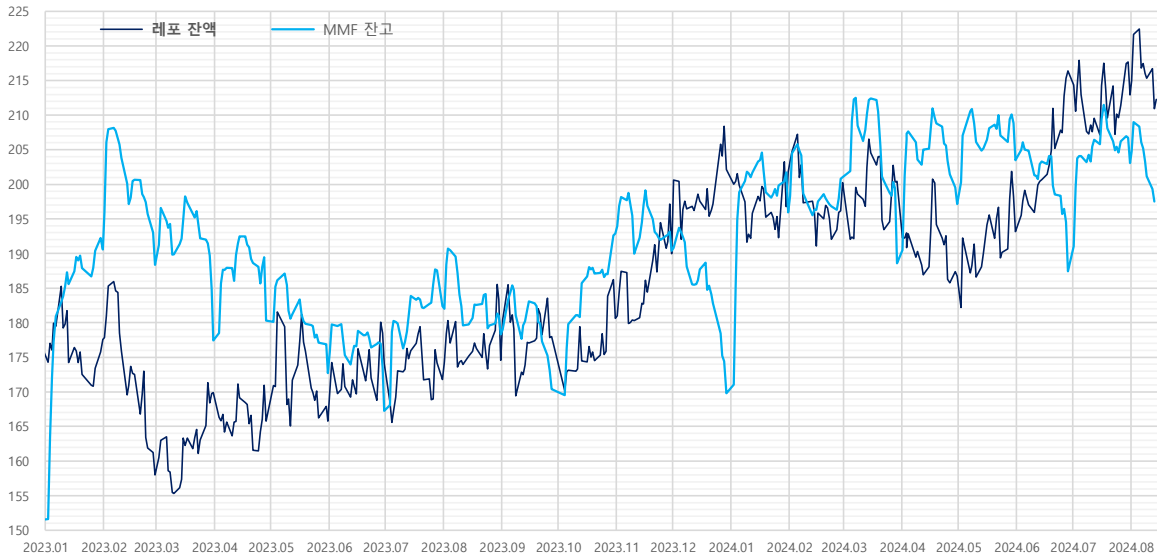
| 지준일   | 2024.09.11(수) | 금통위 | 2024.08.22(목) | FOMC | 2024.09.17(화) ~ 2024.09.18(수) | 한국은행    | <a href="http://www.bok.or.kr">http://www.bok.or.kr</a>       |
|---|---------------|-----|---------------|------|-------------------------------|---------|---|
| · 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24) |               |     |               |      |                               | 경제통계시스템 | <a href="https://ecos.bok.or.kr">https://ecos.bok.or.kr</a>   |
| · 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11)           |               |     |               |      |                               | 무위험지표금리 | <a href="https://www.kofr.kr">https://www.kofr.kr</a>         |
| · 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)               |               |     |               |      |                               | 증권정보포털  | <a href="https://seibro.or.kr">https://seibro.or.kr</a>       |
| · 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)                           |               |     |               |      |                               | 금융투자협회  | <a href="https://kofiabond.or.kr">https://kofiabond.or.kr</a> |

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, 메탁결제원

단기금융시장 금리 추이

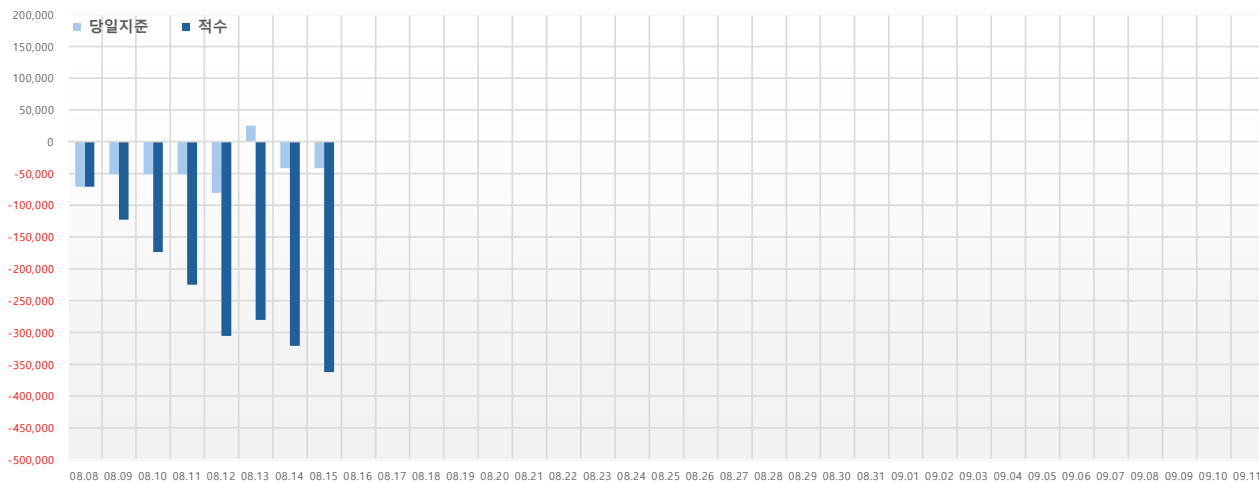


| 기준금리 추이  |            |          |               | 단위 : %P  |               |          |               |
|----------|------------|----------|---------------|----------|---------------|----------|---------------|
| 2024년    | 2023년      | 2022년    | 2021년         |          |               |          |               |
| 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% (▲0.25) | 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       |
|----------|---------|----------|
| 08.08(목) | -70,909 | -70,909  |
| 08.09(금) | -51,344 | -122,329 |
| 08.10(토) | -51,344 | -173,673 |
| 08.11(일) | -51,344 | -225,017 |
| 08.12(월) | -80,547 | -305,606 |
| 08.13(화) | 25,421  | -280,187 |
| 08.14(수) | -41,265 | -321,149 |
| 08.15(목) | -41,265 | -362,414 |
| 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) |         |          |