

레포 시장동향

◎ 지난주

연이은 국고여유자금 환수 영향으로 주초 부족세 강하게 출발했으며, 장 중 체결금리 급등함에 따라 한국은행 RP매입 단행하여 유동성 공급하였음. 건보자금 및 공자기금 유입됐음에도 금리 낙폭 크지 않아 시은 저금리 매도에 주력했고, 주 중 조달여건 점차 개선되는 모습을 보임. 주말 앞두고 적수 관리를 위한 시은 조달 증가하여 매수 자금 일시에 소진됐으나 장 중 운용사 및 신락 추가 자금 유입되어 수급 무난하였음.

◎ 금일

지방소비세 유입에도 적수 관리를 위한 시은 조달 수요 계속되었고, 금리 수준에 따라 매도 규모 가변적이겠음. 건보자금 유효하여 조달여건 대체로 양호할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.08.16 (금)				2024.08.19 (월)			
재정증권 만기(63일)		12,800	공자기금			3,000	
재정 및 기타		21,000	재정 및 기타 [지방소비세8.0]			100,000	
통안채 발행(1년), 낙찰수익률 3.000%		-7,200	국고채 발행(50년)			-3,000	
재정증권 발행(63일)		-10,000	세입 및 기타			-15,000	
공자기금 환수		-8,000					
세입 및 기타		-10,000					
전일 기준	지준	-42,021	적수	-404,223	금일 예상	지준	43,000
						적수	-446,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.08.09(금)	215.3	201.2	3.50%	3.531%	3.518%	3.500%	3.47%	2.941%	2.958%
2024.08.12(월)	216.7	199.3	3.50%	3.534%	3.523%		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	197.1	3.55%	3.561%	3.564%		3.49%	2.888%	2.899%
2024.08.16(금)	214.1		3.53%	3.554%	3.546%		3.51%	2.928%	2.933%

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

◎ 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	주공사/인수사(증거금)
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

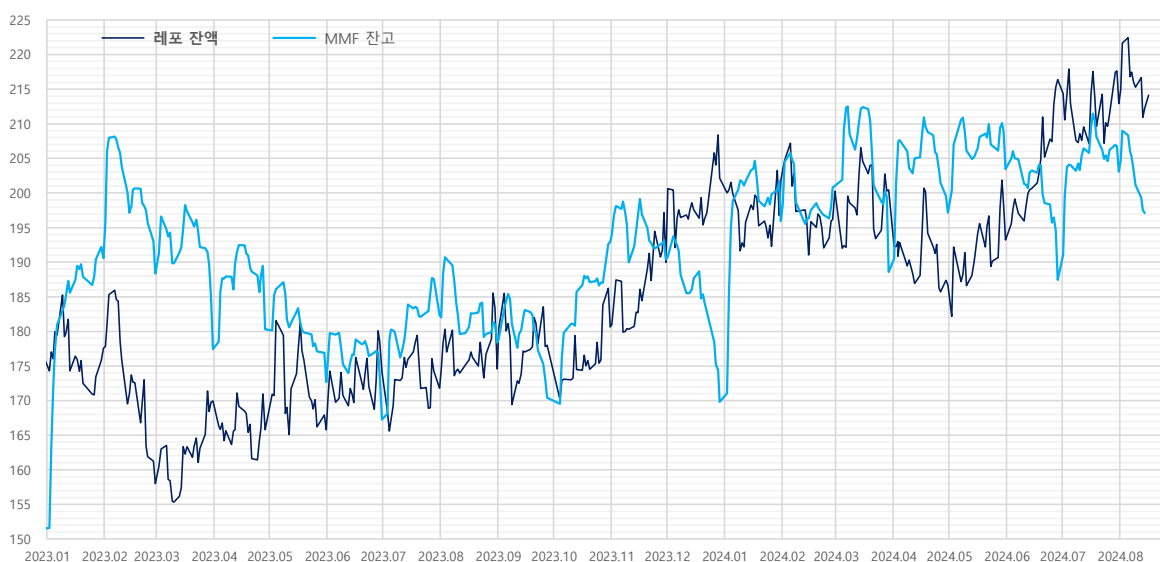
관련 정보

지준일	2024.09.11(수)	금통위	2024.08.22(목)	FOMC	2024.09.17(화) ~ 2024.09.18(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24)							www.kcmire.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&zcdd=002001016&zno=1792&cno=6356
· 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttld=10084595&menuNo=200295
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10082072&menuNo=200690
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10078655&menuNo=200690
							경제통계시스템 https://ecos.bok.or.kr
							무위험지표금리 https://www.kofr.kr
							증권정보포털 https://seibro.or.kr
							금융투자협회 https://kofiabond.or.kr

기준 계산·적립기간, 금통위 및 FOMC

	기준 계산기간		기준 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	월말월 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

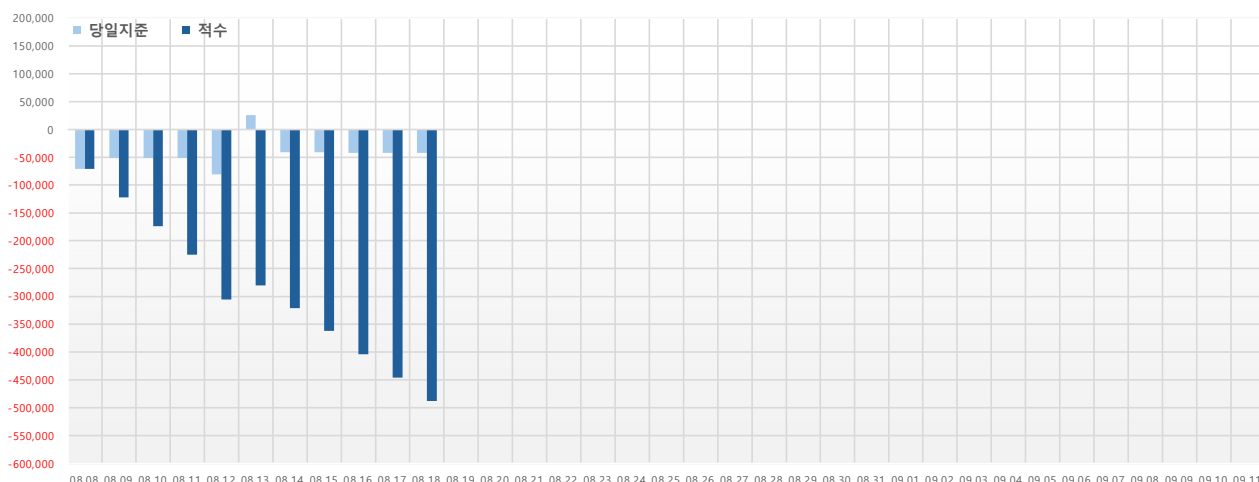


기준금리 추이

	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

당일기준 및 적수 추이



단위 : 억 원

	당일기준	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)	-42,021	-404,223
08.17(토)	-42,021	-446,244
08.18(일)	-42,021	-488,265
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)		