

레포 시장동향

◎ 지난주

주초 지방소비세 유입으로 당일기준 크게 개선되어 시은 조달 강도 다소 약화됐으나 주간 금리 등락과 관계 없이 적수 부족 은행 중심 조달 기초 유지되었음.
주 중 건보자금 유효한 가운데 공자기금 추가 유입되어 조달금리 소폭 하락했고, 운용사 및 신탁 추가 자금 운용되어 저금리 거래 간헐적으로 발생하였음.
주 막판 은행권 익일물 매도 및 증권사 월말 대비 기일물 수요 증가했으며, 시장 유동성 풍부해 조달여건 양호한 모습을 보임.

◎ 금일

별다른 자금 이탈요인 없어 수급 무난할 것으로 기대됨. 은행권 적수 관리를 위한 조달 계속되었으나 적수 부족폭 축소되어 그 규모 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.08.23 (금)				2024.08.26 (월)					
공자기금		5,000		재정 및 기타			14,000		
국고채 조기환매		30,000							
재정 및 기타		19,000							
세입 및 기타		-20,000		세입 및 기타			-7,000		
전일 기준	지준	70,162	적수	-353,178	금일 예상	지준	77,000	적수	-135,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.08.19(월)	218.3	201.1	3.53%	3.538%	3.546%		3.51%	2.927%	2.942%
2024.08.20(화)	216.4	200.4	3.51%	3.523%	3.527%		3.51%	2.944%	2.959%
2024.08.21(수)	214.8	200.0	3.53%	3.536%	3.546%	3.500%	3.52%	2.940%	2.960%
2024.08.22(목)	212.5	198.5	3.53%	3.538%	3.546%		3.51%	2.907%	2.933%
2024.08.23(금)	214.5		3.50%	3.523%	3.519%		3.51%	2.920%	2.953%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2024.08.22(목)	3.50% (동결)	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)
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)

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰액	금리	낙찰액	낙찰률	회차번호
2024.08.22(목)	15:00~15:10	7	2024.08.29(목)	7.18	3.50%	0.50	7.0%	2024-044-007

◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정액	응찰금액	낙찰금리	낙찰액	회차번호
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
2024.08.20(화)	14:00~14:10	30	2024.09.19(목)	0.20	0.62	3.48%	0.20	2024-0031-0030

청약 정보

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사/인수사(증거금)
공모주	아이스크림미디어	교육 미디어 기업	2024.08.21(수) ~ 2024.08.22(목)	2024.08.26(월)	삼성(1,522억)
공모주	미래에셋비전스팩7호	기업인수목적회사	2024.09.02(월) ~ 2024.09.03(화)	2024.09.05(목)	미래

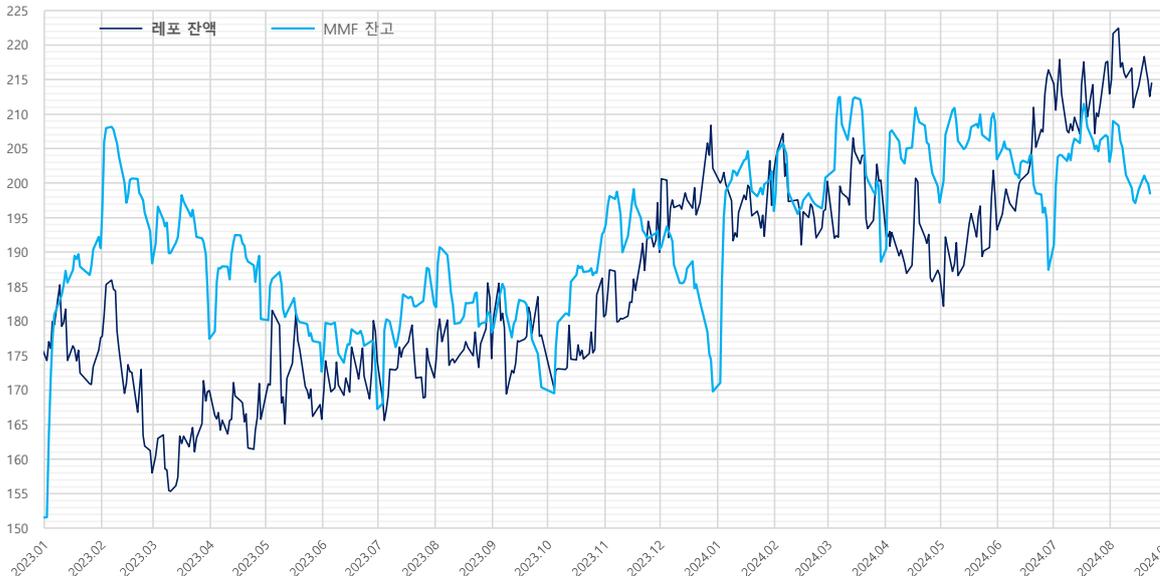
관련 정보

지준일	2024.09.11(수)	금통위	2024.10.11(금)	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.kcmmi.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					무위험지표금리	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

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

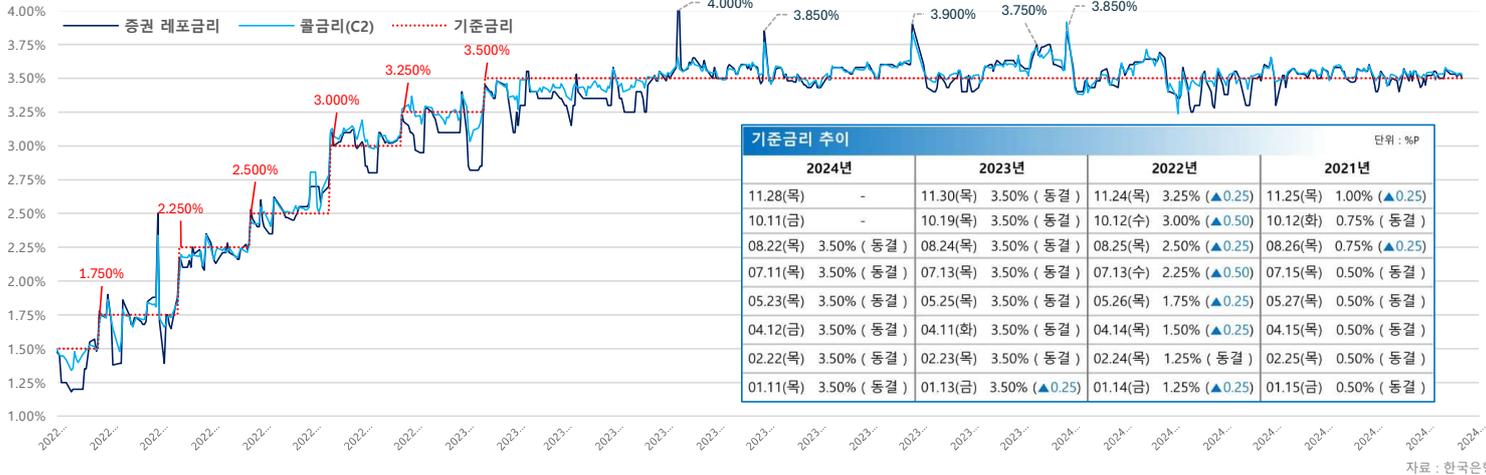


단위 : 조 원

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 : 금융부서협회, 예탁결제원

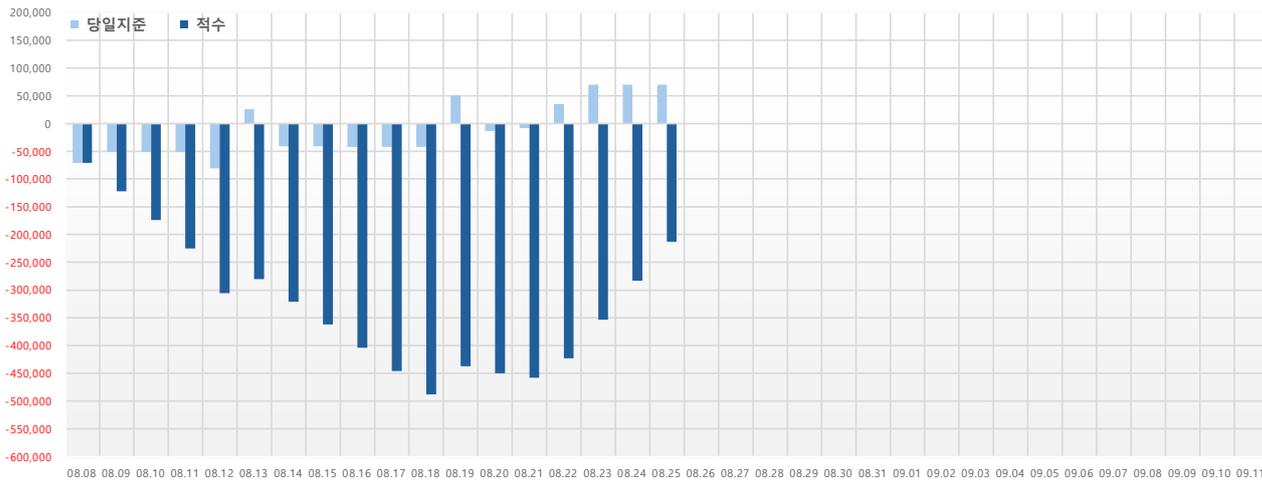
단기금융시장 금리 추이



기준금리 추이 (단위 : %P)

2024년	2023년	2022년	2021년
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(금) 3.50% (동결)	10.12(화) 3.00% (▲0.50)
08.22(목)	3.50% (동결)	08.24(목) 3.50% (동결)	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)
05.23(목)	3.50% (동결)	05.25(목) 3.50% (동결)	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)
02.22(목)	3.50% (동결)	02.23(목) 3.50% (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)

당일기준 및 적수 추이



단위 : 억 원

당일기준	적수
08.08(목)	-70,909
08.09(금)	-51,344
08.10(토)	-51,344
08.11(일)	-51,344
08.12(월)	-80,547
08.13(화)	25,421
08.14(수)	-41,265
08.15(목)	-41,265
08.16(금)	-42,021
08.17(토)	-42,021
08.18(일)	-42,021
08.19(월)	50,862
08.20(화)	-12,989
08.21(수)	-7,767
08.22(목)	34,830
08.23(금)	70,162
08.24(토)	70,162
08.25(일)	70,162
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)	