

레포 시장동향

◎ 전일

월초 MMF 설정 및 공자기금 유입 이어져 유동성 풍부했으며, 은행권 조달 감소한 반면 매수 증가하여 장 중 잉여세 심화되었음.

◎ 금일

국고금 및 청약자금 유입되어 잉여 분위기 지속되겠음. 은행권 양방향 움직임 혼재하겠으며, 금리 수준에 따라 그 규모 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2024.09.03 (화) | | | | 2024.09.04 (수) | | | | | |
|---------------------------|----|---------|----|----------------|-------|----|----------|----|---------|
| 통안채 만기(3년) | | 49,000 | | 금융중개지원대출 | | | 5,000 | | |
| 통안채 만기(91일) | | 5,400 | | 공자기금 | | | 5,000 | | |
| 통안채 이자 | | 3,500 | | 국고여유자금 | | | 26,000 | | |
| 공자기금 | | 24,000 | | 재정 및 기타 | | | 14,000 | | |
| 재정 및 기타 | | 20,000 | | | | | | | |
| 통안계정(28일) | | -1,000 | | 월말세입 및 기타 | | | -135,000 | | |
| 통안채 발행(91일), 낙찰할인을 3.080% | | -8,000 | | 화폐발행 | | | -5,000 | | |
| 국고채 발행(30년) | | -24,000 | | | | | | | |
| 월말세입 및 기타 | | -95,000 | | | | | | | |
| 화폐 발행 | | -5,000 | | | | | | | |
| 전일 기준 | 지준 | 47,137 | 적수 | 551,546 | 금일 예상 | 지준 | -43,000 | 적수 | 509,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2024.08.28(수) | 219.3 | 200.3 | 3.48% | 3.505% | 3.500% | 3.500% | 3.52% | 2.919% | 2.977% |
| 2024.08.29(목) | 219.8 | 199.7 | 3.43% | 3.503% | 3.454% | | 3.52% | 2.939% | 3.000% |
| 2024.08.30(금) | 211.5 | 195.4 | 3.53% | 3.543% | 3.546% | | 3.52% | 2.953% | 3.010% |
| 2024.09.02(월) | 215.1 | 195.8 | 3.50% | 3.521% | 3.519% | | 3.52% | 2.989% | 3.049% |
| 2024.09.03(화) | 213.4 | | 3.50% | 3.507% | 3.519% | | 3.51% | 2.981% | 3.051% |

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 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|-------|------|------|--------------|
| 2024.08.29(목) | 14:00~14:10 | 7 | 2024.09.05(목) | 2.80 | 3.50% | 0.20 | 7.1% | 2024-045-007 |

◎ 통화안정계정예치금

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 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 |
| 2024.08.27(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.09.24(화) | 0.10 | 0.41 | 3.47% | 0.10 | 2024-0032-0028 |
| 2024.09.03(화) | 14:00~14:10 | 29 | 2024.10.02(수) | 0.10 | 0.32 | 3.46% | 0.10 | 2024-0033-0029 |

청약 정보

| 구분 | 청약명 | 업체 | 모집일 | 환불일 | 주간사/인수사(증거금) |
|-----|------------|-------------|-------------------------------|---------------|--------------|
| 공모주 | 미래에셋비전스팩7호 | 기업인수목적회사 | 2024.09.02(월) ~ 2024.09.03(화) | 2024.09.05(목) | 미래(3.99조) |
| 공모주 | 아이엔디바이스 | 반도체 설계 전문기업 | 2024.09.09(월) ~ 2024.09.10(화) | 2024.09.12(목) | 대신 |
| 공모주 | 키움스팩9호 | 기업인수목적회사 | 2024.09.09(월) ~ 2024.09.10(화) | 2024.09.12(목) | 키움 |
| 실권주 | 뉴보텍 | 상하수도관 제조 기업 | 2024.09.09(월) ~ 2024.09.10(화) | 2024.09.12(목) | SK |
| 공모주 | KB스팩30호 | 기업인수목적회사 | 2024.09.10(화) ~ 2024.09.11(수) | 2024.09.13(금) | KB |
| 실권주 | 디엑스앤브이엑스 | 바이오헬스케어 기업 | 2024.09.10(화) ~ 2024.09.11(수) | 2024.09.13(금) | 유진 |
| 실권주 | 삼성FN리츠 | 리츠(REITs) | 2024.09.12(목) ~ 2024.09.13(금) | 2024.09.20(금) | 삼성, KB |

관련 정보

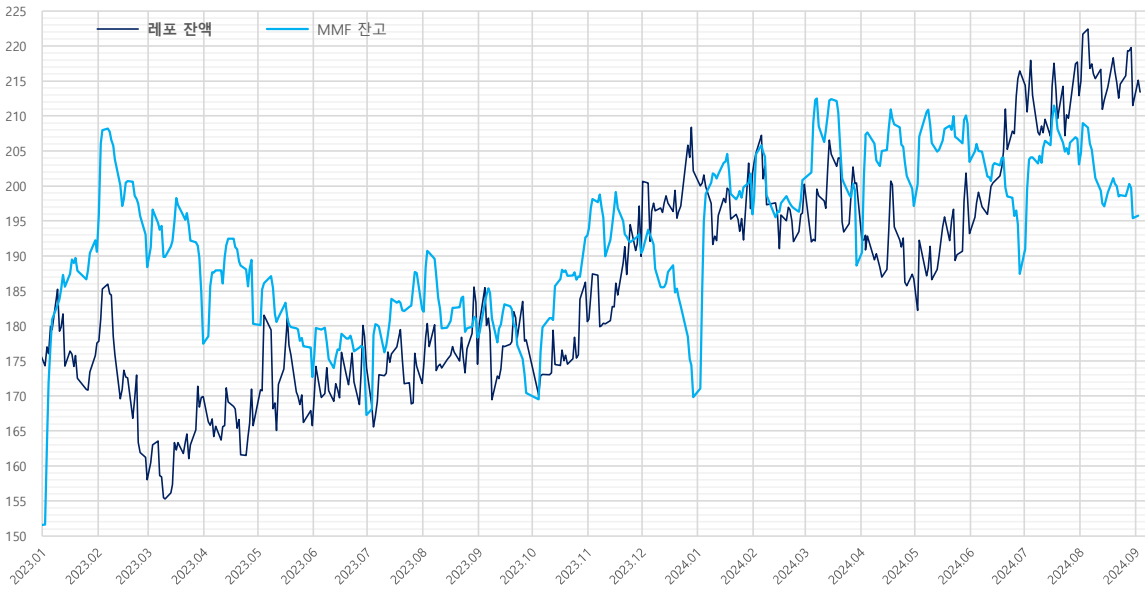
| 지준일 | 2024.09.11(수) | 금통위 | 2024.10.11(금) | FOMC | 2024.09.17(화) ~ 2024.09.18(수) | 한국은행 | http://www.bok.or.kr |
|---|---------------|-----|---------------|------|-------------------------------|---------|--|
| · 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24) | | | | | | | www.kcmi.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&rcd=002001016&zno=1792&cno=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://kofiafond.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) | | 06.11(화) ~ 06.12(수) |
| 2024년 6월 | 06.01(토) | 06.30(일) | 07.11(목) | 08.07(수) | | 06.13(목) | 06.26(수) | 07.30(화) ~ 07.31(수) |
| 2024년 7월 | 07.01(월) | 07.31(수) | 08.08(목) | 09.11(수) | 07.11(목) | 07.18(목) | | |
| 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(금) | 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

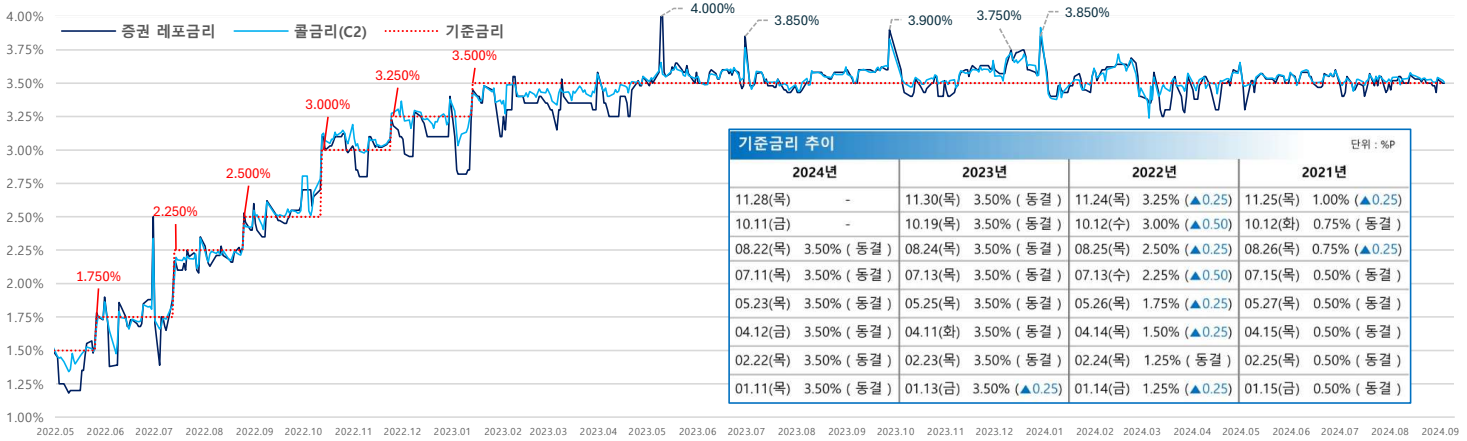
단위 : 조 원



| 해당연월 | 월말일 MMF 증감내역 | | |
|------------|--------------|-------|-------|
| | MMF | 전월대비 | 전월대비 |
| 2024.08.30 | 195.4 | -4.3 | -7.6 |
| 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, 애탁결제원

단기금융시장 금리 추이

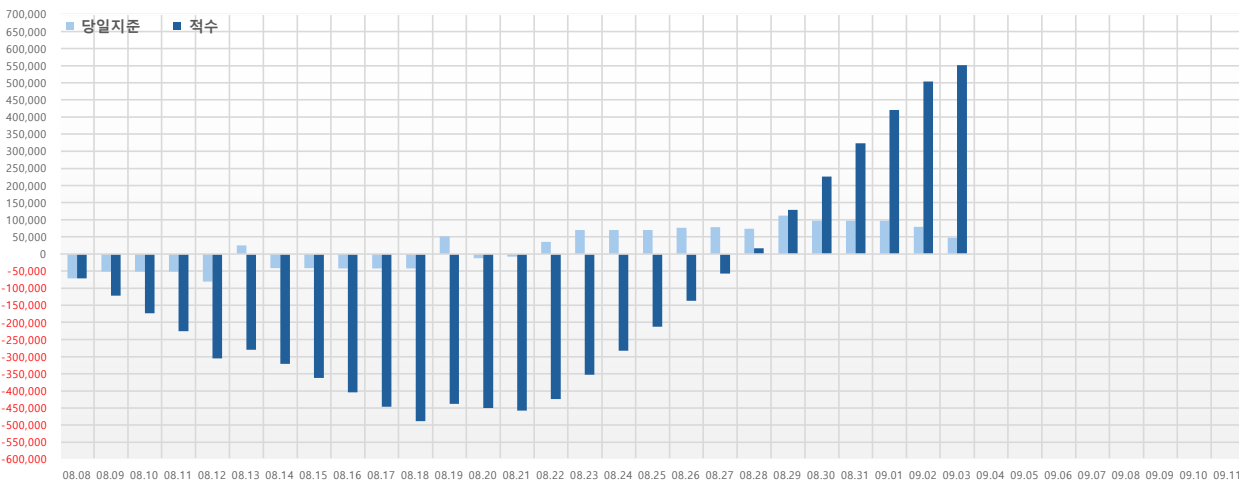


| 기준금리 추이 | | | | 단위 : %P |
|----------|------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| 2024년 | 2023년 | 2022년 | 2021년 | |
| 11.28(목) | - | 11.30(목) 3.50% (동결) | 11.24(목) 3.25% (▲0.25) | 11.25(목) 1.00% (▲0.25) |
| 10.11(금) | - | 10.19(금) 3.50% (동결) | 10.12(수) 3.00% (▲0.50) | 10.12(화) 0.75% (동결) |
| 08.22(목) | 3.50% (동결) | 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) | -42,021 | -404,223 |
| 08.17(토) | -42,021 | -446,244 |
| 08.18(일) | -42,021 | -488,265 |
| 08.19(월) | 50,862 | -437,406 |
| 08.20(화) | -12,989 | -450,396 |
| 08.21(수) | -7,767 | -458,168 |
| 08.22(목) | 34,830 | -423,336 |
| 08.23(금) | 70,162 | -353,178 |
| 08.24(토) | 70,162 | -283,016 |
| 08.25(일) | 70,162 | -212,854 |
| 08.26(월) | 76,053 | -136,601 |
| 08.27(화) | 78,825 | -57,776 |
| 08.28(수) | 74,159 | 16,487 |
| 08.29(목) | 111,909 | 128,295 |
| 08.30(금) | 97,277 | 225,493 |
| 08.31(토) | 97,277 | 322,770 |
| 09.01(일) | 97,277 | 420,047 |
| 09.02(월) | 79,088 | 504,072 |
| 09.03(화) | 47,137 | 551,546 |
| 09.04(수) | | |
| 09.05(목) | | |
| 09.06(금) | | |
| 09.07(토) | | |
| 09.08(일) | | |
| 09.09(월) | | |
| 09.10(화) | | |
| 09.11(수) | | |