

레포 시장동향

◎ 전일

국고금 환수 및 청약 환불 영향으로 유동성 축소됐으며, 은행권 양방향 움직임 혼재했음. 장 중 부족 분위기 형성되어 익일물 및 기일물 체결금리 상승하였음.

◎ 금일

국고여유자금 환수 계속되는 가운데 조달금리 추가 상승할 것으로 예상됨. 금리 수준에 따라 은행권 운용-조달 규모 가변적이겠고, 이에 따라 수급 상황 결정될 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.09.05 (목)				2024.09.06 (금)					
한은RP매각 만기(7일)		2,000		공자기금		8,000			
재정증권 만기(63일)		10,000		재정 및 기타		30,000			
재정 및 기타		31,000							
한은RP매각(7일)		-7,000		국고여유자금 환수		-23,000			
통안채 발행(2년), 낙찰수익률 2.990%		-20,000		세입 및 기타		-7,000			
공자기금 환수		-10,000		화폐 발행		-5,000			
국고여유자금 환수		-6,000							
세입 및 기타		-20,000							
화폐 발행		-4,000							
전일 기준	지준	-48,560	적수	496,988	금일 예상	지준	-46,000	적수	451,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.08.30(금)	211.5	195.4	3.53%	3.543%	3.546%	3.500%	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	198.4	3.50%	3.507%	3.519%		3.51%	2.981%	3.051%
2024.09.04(수)	217.7	197.2	3.48%	3.521%	3.501%		3.51%	2.931%	2.996%
2024.09.05(목)	216.5		3.52%	3.546%	3.538%		3.51%	2.905%	2.971%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2024.08.22(목)	3.50% (동 결)	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)
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)

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰액	금리	낙찰액	낙찰률	회차번호
2024.09.05(목)	14:00~14:10	7	2024.09.12(목)	6.18	3.50%	0.70	11.3%	2024-046-007

◎ 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	아이언디바이스	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

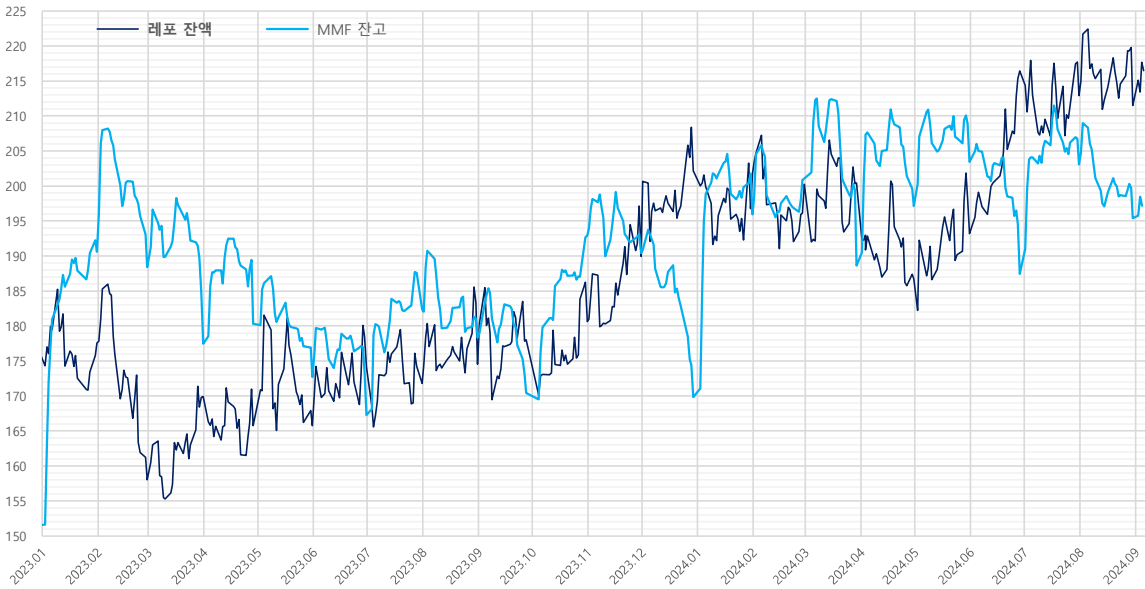
지준일	2024.09.11(수)	금통위	2024.10.11(금)	FOMC	2024.09.17(화) ~ 2024.09.18(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24)						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)						증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						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)		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)		09.17(화) ~ 09.18(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)	
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

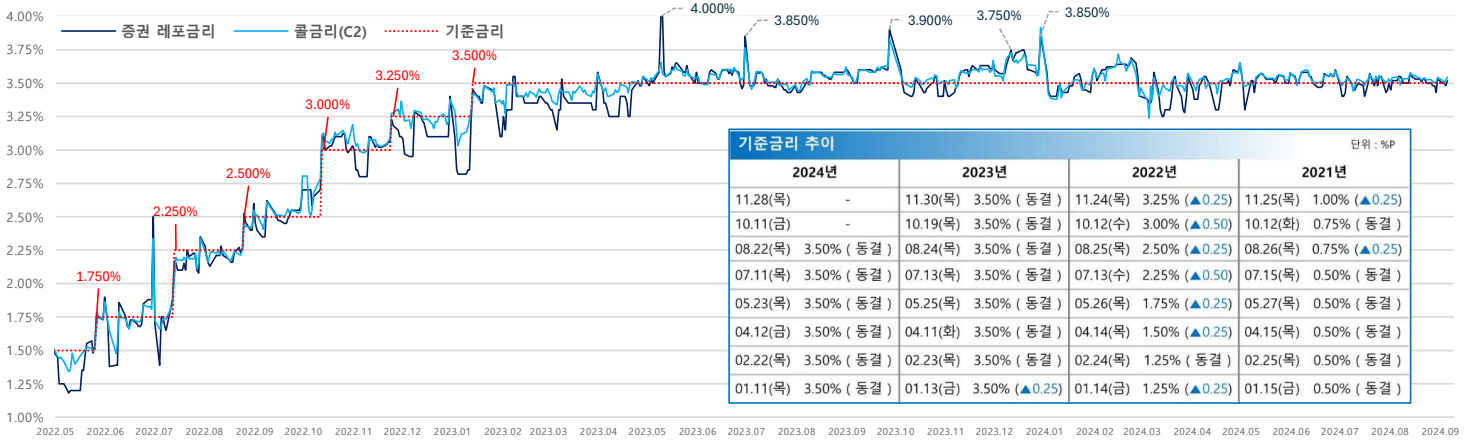
단위 : 조 원



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

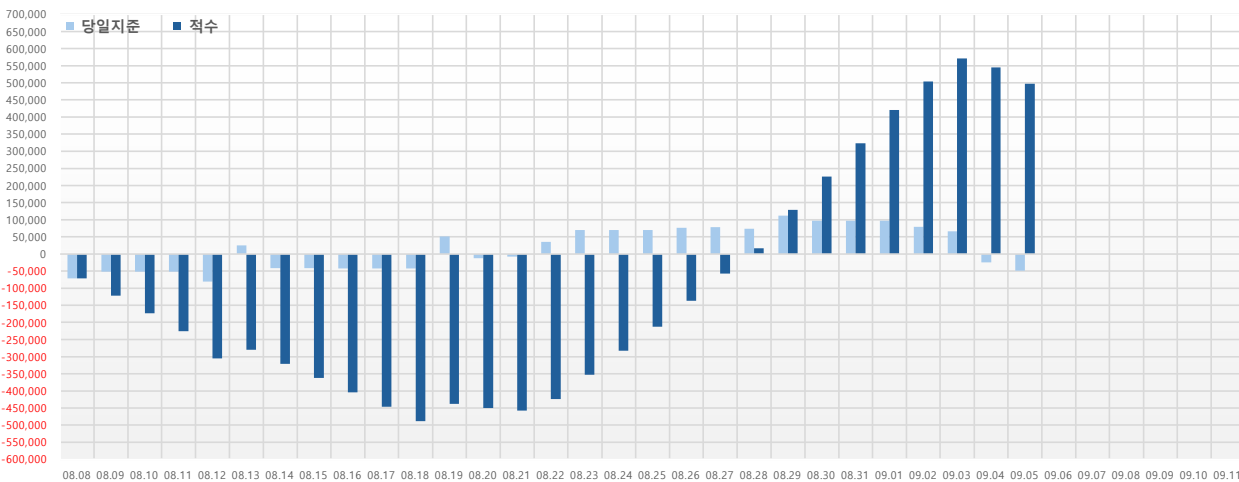


기준금리 추이				단위 : %P
2024년	2023년	2022년	2021년	
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(금) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목)	3.50% (동결)	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	3.50% (동결)	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)	66,350	570,759
09.04(수)	-25,069	545,549
09.05(목)	-48,560	496,988
09.06(금)		
09.07(토)		
09.08(일)		
09.09(월)		
09.10(화)		
09.11(수)		