

레포 시장동향

◎ 전일

공자기금 환수 및 MMF 판매 영향으로 조달금리 상승했으나 은행권 매도 감소한 반면, 운용 증가하여 수급 대체로 무난하였음.

◎ 금일

분기말 앞두고 유동성 축소되었으나 전일 한은RP 감액과 금일 행안부 재정 유입에 따른 은행권 운용 기대됨. 기일물 탐색 이어지겠고, 회사채 일부 난항을 겪을 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2024.09.26 (목) | | | | 2024.09.27 (금) | | | |
|--------------------------|-----------|----------------|-----------|----------------|-----------|---------------|-----------------|
| 한은RP매각 만기(7일) | | 40,000 | | 국고채 조기환매 | | 30,000 | |
| 재정 및 기타 | | 14,000 | | 재정 및 기타 [행안부] | | 60,000 | |
| 한은RP매각(8일) | | -10,000 | | 세입 및 기타 | | -14,000 | |
| 통안채 발행(2년), 시장수익률 2.930% | | -4,000 | | | | | |
| 통안채 발행(3년), 시장수익률 2.940% | | -2,000 | | | | | |
| 공자기금 환수 | | -25,000 | | | | | |
| 세입 및 기타 | | -17,000 | | | | | |
| 전일 기준 | 지준 | -14,569 | 적수 | 금일 예상 | 지준 | 61,000 | 적수 |
| | | | | | | | -145,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2024.09.20(금) | 221.1 | 191.5 | 3.48% | 3.505% | 3.498% | 3.500% | 3.53% | 2.838% | 2.868% |
| 2024.09.23(월) | 220.2 | 191.0 | 3.46% | 3.499% | 3.481% | | 3.53% | 2.864% | 2.904% |
| 2024.09.24(화) | 218.3 | 188.0 | 3.48% | 3.509% | 3.501% | | 3.53% | 2.854% | 2.903% |
| 2024.09.25(수) | 221.6 | 187.6 | 3.48% | 3.509% | 3.502% | | 3.53% | 2.812% | 2.873% |
| 2024.09.26(목) | 222.1 | | 3.53% | 3.531% | 3.547% | | 3.53% | 2.807% | 2.875% |

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 |
|---------------|-------------|----|---------------|-------|-------|------|------|--------------|
| 2024.09.26(목) | 14:00~14:10 | 8 | 2024.10.04(금) | 12.31 | 3.50% | 1.00 | 8.1% | 2024-050-008 |

◎ 통화안정계정예치금

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 2024.09.03(화) | 14:00~14:10 | 29 | 2024.10.02(수) | 0.10 | 0.32 | 3.46% | 0.10 | 2024-0033-0029 |
| 2024.09.19(목) | 14:00~14:10 | 26 | 2024.10.15(화) | 0.50 | 0.95 | 3.47% | 0.50 | 2024-0034-0026 |
| 2024.09.24(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.10.22(화) | 0.30 | 1.29 | 3.45% | 0.30 | 2024-0035-0028 |

청약 정보

| 구분 | 청약명 | 업체 | 모집일 | 환불일 | 주간사/인수사(증거금) |
|-----|------|--------------------|-------------------------------|---------------|--------------|
| 공모주 | 셀비온 | 방사성의약품 신약 개발 기업 | 2024.10.07(월) ~ 2024.10.08(화) | 2024.10.11(금) | 대신 |
| 공모주 | 한캠 | 유기화합물 합성전문 CRO 기업 | 2024.10.07(월) ~ 2024.10.08(화) | 2024.10.11(금) | 신영, 유진 |
| 공모주 | 인스피언 | 기업 AP통합 및 보안솔루션 기업 | 2024.10.07(월) ~ 2024.10.08(화) | 2024.10.11(금) | 한투 |

관련 정보

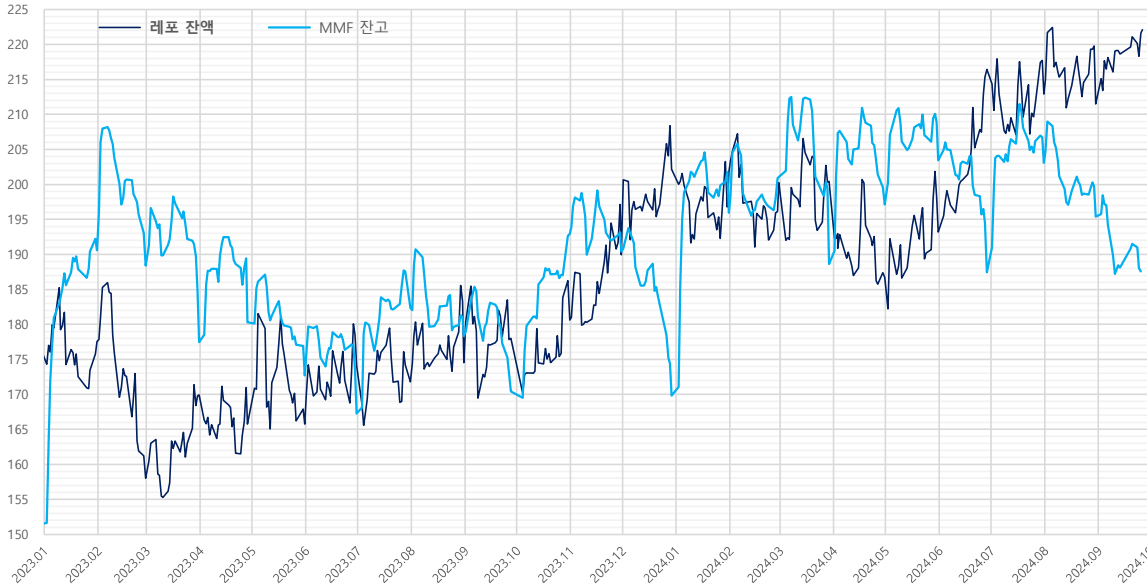
| 지준일 | 2024.10.09(수) | 금통위 | 2024.10.11(금) | FOMC | 2024.11.06(수) ~ 2024.11.07(목) | 한국은행 | http://www.bok.or.kr |
|---|---------------|-----|---------------|------|-------------------------------|------|--|
| · 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24) | | | | | | | www.kcmi.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&zcd=002001016&zno=1792&cn=6356 |
| · 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11) | | | | | | | https://ecos.bok.or.kr |
| · 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11) | | | | | | | https://www.kofr.kr |
| · 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25) | | | | | | | https://seibro.or.kr |
| · 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27) | | | | | | | 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) | | |
| 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

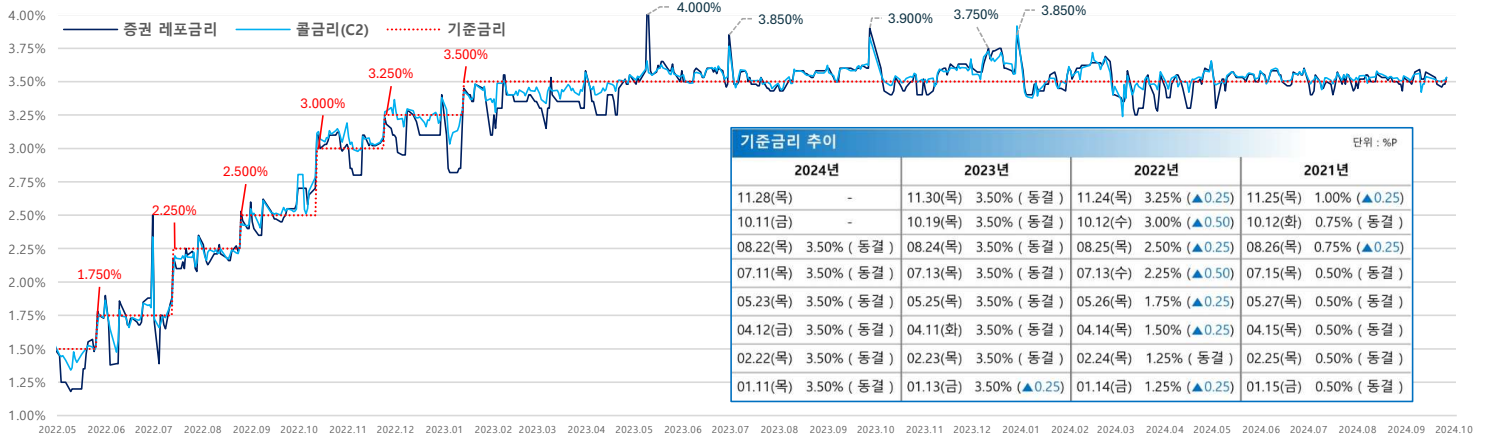
단위 : 조 원



| 해당연월 | MMF | 전일대비 | 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, 예탁결제원

단기금융시장 금리 추이

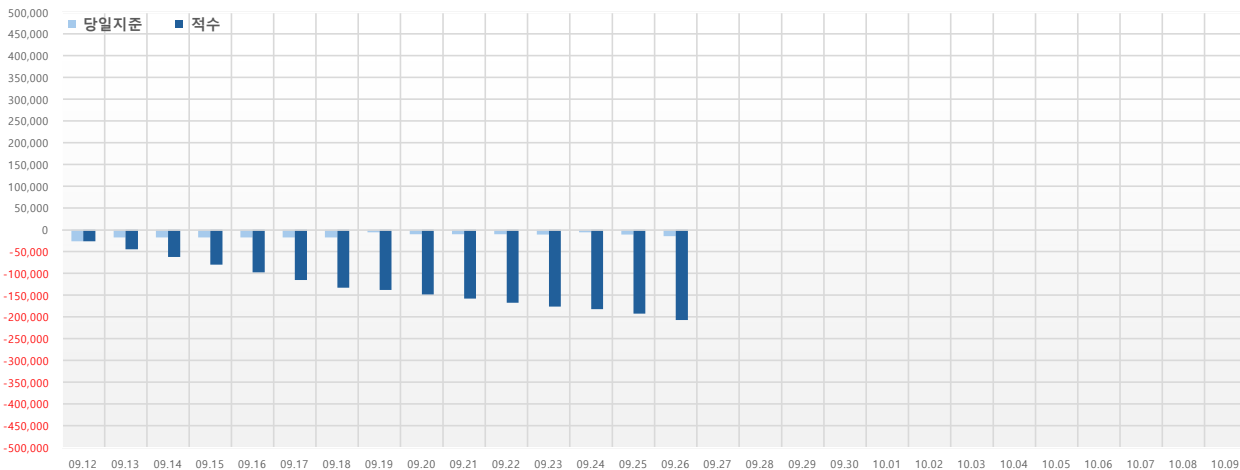


| 기준금리 추이 | | | | 단위 : %P | | | |
|----------|------------|----------|---------------|----------|---------------|----------|---------------|
| 2024년 | 2023년 | 2022년 | 2021년 | | | | |
| 11.28(목) | - | 11.30(목) | 3.50% (동결) | 11.24(목) | 3.25% (▲0.25) | 11.25(목) | 1.00% (▲0.25) |
| 10.11(금) | - | 10.19(목) | 3.50% (동결) | 10.12(수) | 3.00% (▲0.50) | 10.12(화) | 0.75% (동결) |
| 08.22(목) | 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 | |
|----------|---------|----------|
| 09.12(목) | -26,505 | -26,505 |
| 09.13(금) | -17,708 | -44,304 |
| 09.14(토) | -17,708 | -62,012 |
| 09.15(일) | -17,708 | -79,720 |
| 09.16(월) | -17,708 | -97,428 |
| 09.17(화) | -17,708 | -115,136 |
| 09.18(수) | -17,708 | -132,844 |
| 09.19(목) | -5,140 | -138,066 |
| 09.20(금) | -9,765 | -147,833 |
| 09.21(토) | -9,765 | -157,598 |
| 09.22(일) | -9,765 | -167,363 |
| 09.23(월) | -10,211 | -176,250 |
| 09.24(화) | -5,373 | -181,625 |
| 09.25(수) | -10,601 | -192,206 |
| 09.26(목) | -14,569 | -206,776 |
| 09.27(금) | | |
| 09.28(토) | | |
| 09.29(일) | | |
| 09.30(월) | | |
| 10.01(화) | | |
| 10.02(수) | | |
| 10.03(목) | | |
| 10.04(금) | | |
| 10.05(토) | | |
| 10.06(일) | | |
| 10.07(월) | | |
| 10.08(화) | | |
| 10.09(수) | | |