

레포 시장동향

◎ 지난주

주초 풍부한 유동성을 바탕으로 조달금리 낮게 유지됐으며, 공모주(제닉스) 청약 환불 및 건보자금 이탈에도 금리 상승세 완만하였음.
외은 중심 잉여세 두드러진 가운데 한은RP매각 감액 등 영향으로 시은 조달보다 운용에 적극적으로 나서 수급 무난한 흐름을 이어감.
주 후반부로 갈수록 공자기금 환수 및 MMF 환매에 따른 유동성 축소 감지됐으나 일반채 해소는 무난하였고, 회사채 정채 점차 심화되었음.

◎ 금일

분기말 운용사 및 신탁 유동성 축소되겠으나 공자기금 유입과 은행권 운용에 힘입어 일반채 조달여건 양호할 것으로 기대됨. 회사채 난항 지속될 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.09.27 (금)				2024.09.30 (월)				
국고채 조기환매		30,000		공자기금			51,000	
재정 및 기타 [행안부4.2]		62,000		재정 및 기타			16,000	
세입 및 기타		-19,000		국고채 발행(5년)			-13,000	
				국고채 발행(20년)			-3,000	
				세입 및 기타			-42,000	
전일 기준	지준	57,738	적수	금일 예상	지준	67,000	적수	33,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.09.23(월)	220.2	191.0	3.46%	3.499%	3.481%	3.500%	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	185.5	3.53%	3.531%	3.547%		3.53%	2.807%	2.875%
2024.09.27(금)	223.7		3.55%	3.535%	3.564%		3.53%	2.826%	2.889%

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	한켄	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

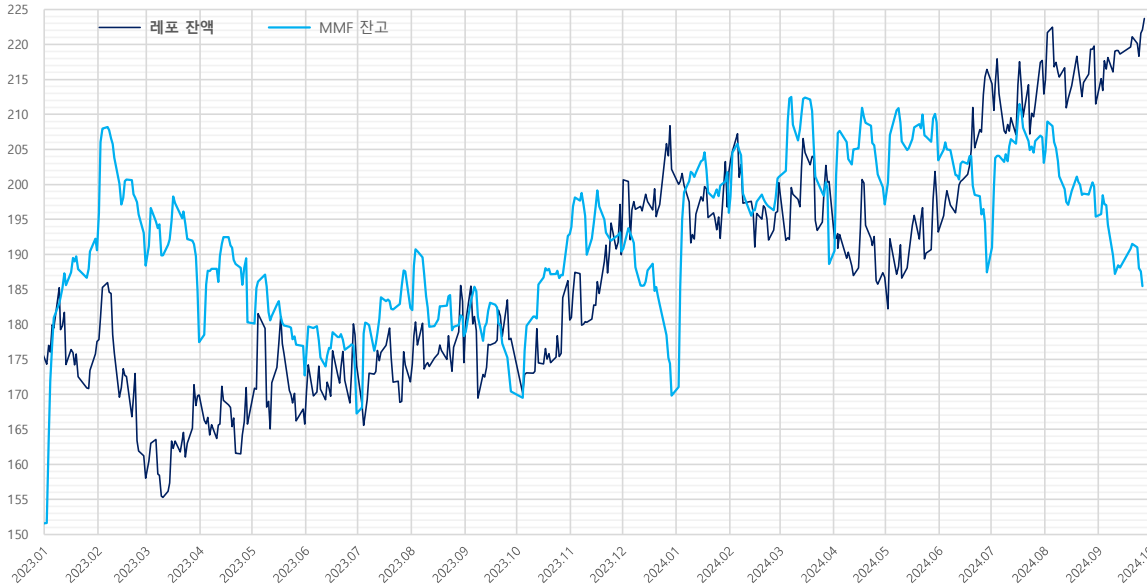
지준일	2024.10.09(수)	금통위	2024.10.11(금)	FOMC	2024.11.06(수) ~ 2024.11.07(목)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24)							www.kcmti.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&zcd=002001016&zno=1792&cno=6356
· 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlid=10084595&menuNo=200295
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=10082072&menuNo=200690
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=10078655&menuNo=200690
							경제통계시스템 https://ecos.bok.or.kr
							무위험지표금리 https://www.kofr.kr
							증권정보포털 https://seibro.or.kr
							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)		
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

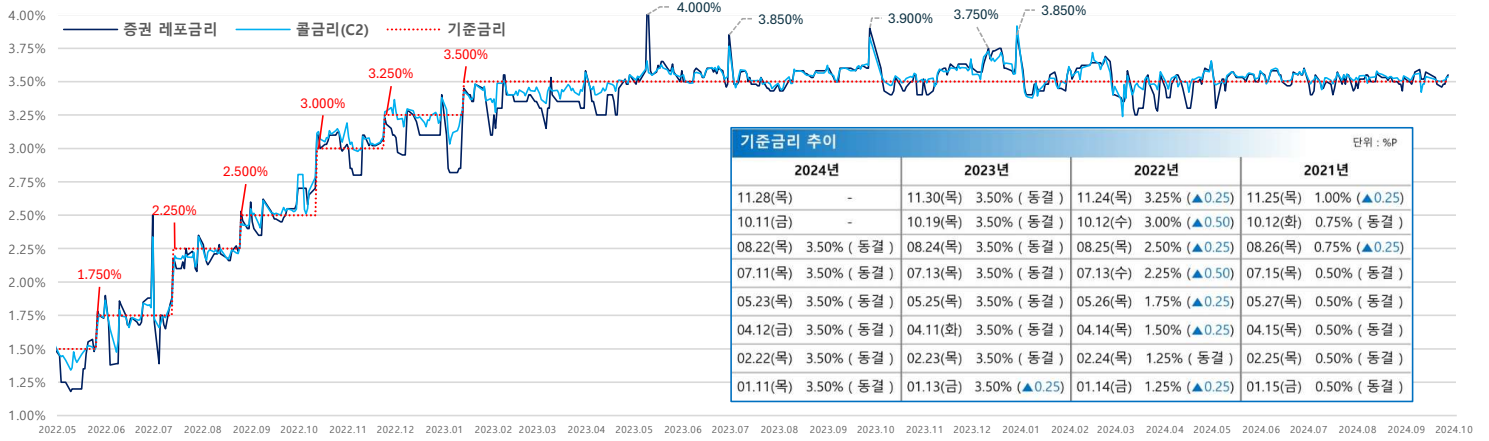
단위 : 조 원



해당연월	MMF	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, 예탁결제원

단기금융시장 금리 추이

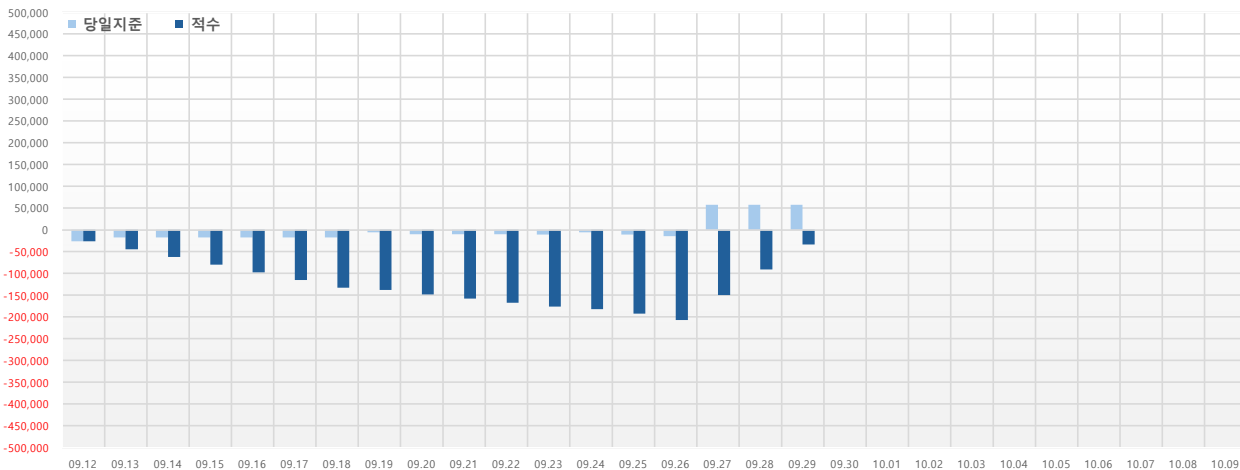


기준금리 추이				단위 : %P
2024년	2023년	2022년	2021년	
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목)	3.50% (동결)	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	3.50% (동결)	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)	57,738	-149,037
09.28(토)	57,738	-91,299
09.29(일)	57,738	-33,561
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)		