

레포 시장동향

- ◎ **지난주**
주초 마감 불확실성 확대되어 은행권 양방향 움직임 혼재했으며, 한국은행 기준일 직전 RP매입(2일물, 1.5조) 단행하여 소폭 잉여 마감하였음.
금통위 앞두고 매수 급증하여 일시적인 잉여장 형성됐으나 일반채 조달여건 양호했던 반면, 회사채 매수처 많지 않아 정체 극심하였음.
기준금리 인하에 따른 시장 유동성 축소 영향으로 장 초반부터 부족세 강했고, 장 중 시은 매수 참여 계속됐음에도 막판까지 수급 빠듯한 모습을 보임.

- ◎ **금일**
국고금 및 청약자금 유입되어 일반채 조달여건 소폭 개선될 것으로 기대되나 여전히 은행권 매수 의존도 높겠고, 회사채 난항 이어지겠음.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.10.11 (금)				2024.10.14 (월)					
한은RP매각 만기(7일)		50,000	국고여유자금		25,000				
재정 및 기타		36,000	재정 및 기타		19,000				
한은RP매각(6일)		-5,000	원천세 및 기타		-100,000				
통안채 발행(1년), 낙찰수익률 2.900%		-5,900							
원천세 및 기타		-37,000							
전일 기준	지준	37,373	적수	37,051	금일 예상	지준	-18,000	적수	93,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.10.04(금)	223.9	187.8	3.45%	3.494%	3.472%	3.500%	3.52%	2.824%	2.899%
2024.10.07(월)	221.1	191.9	3.50%	3.473%	3.532%		3.51%	2.960%	3.018%
2024.10.08(화)	221.9	191.8	3.50%	3.483%	3.531%		3.51%	2.932%	2.998%
2024.10.10(목)	218.5	188.7	3.50%	3.517%	3.517%	3.50%	2.962%	3.014%	
2024.10.11(금)	218.2		3.30%	3.312%	3.323%	3.250%	3.40%	2.947%	2.998%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2024.10.11(금)	3.25% (▼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)
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)

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰액	금리	낙찰액	낙찰률	회차번호
2024.10.11(금)	14:00~14:10	6	2024.10.17(목)	7.05	3.50%	0.50	7.1%	2024-053-006

◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정액	응찰금액	낙찰금리	낙찰액	회차번호
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
2024.10.02(수)	14:00~14:10	27	2024.10.29(화)	0.50	1.30	3.40%	0.50	2024-0036-0027

청약 정보

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사/인수사(증거금)
공모주	와이제이링크	SMT(표면실장기술) 장비 기업	2024.10.10(목) ~ 2024.10.11(금)	2024.10.15(화)	KB(5.13조)
공모주	루미르	인공위성 개발 기업	2024.10.10(목) ~ 2024.10.11(금)	2024.10.15(화)	NH(4,708억)
공모주	에이치엔에스하이텍	이방선전도필름(ACF) 제조 기업	2024.10.14(월) ~ 2024.10.15(화)	2024.10.17(목)	미래
공모주	씨메스	산업용 로봇 기업	2024.10.15(화) ~ 2024.10.16(수)	2024.10.18(금)	삼성, 유진 / 유안타
공모주	클로봇	실내 자율주행로봇 기업	2024.10.16(수) ~ 2024.10.17(목)	2024.10.21(월)	미래 / 신영
공모주	웨이비스	반도체 및 응용 모듈 개발 기업	2024.10.17(목) ~ 2024.10.18(금)	2024.10.22(화)	대신
실권주	경남제약	일반의약품 전문 기업	2024.10.17(목) ~ 2024.10.18(금)	2024.10.22(화)	SK

관련 정보

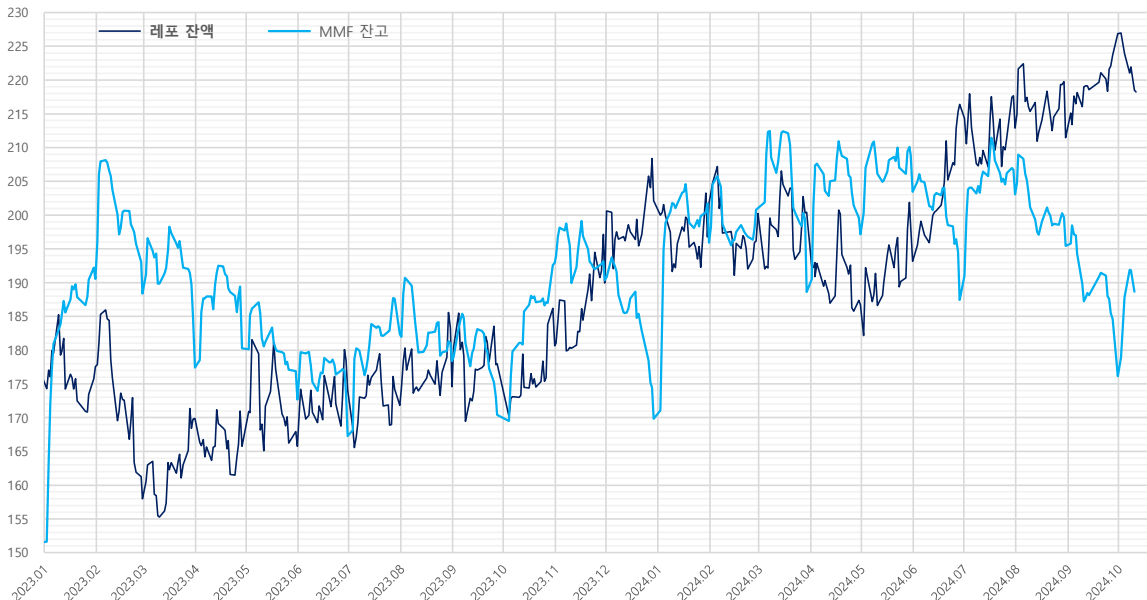
지준일	2024.11.06(수)	금통위	2024.11.28(목)	FOMC	2024.11.06(수) ~ 2024.11.07(목)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24)	www.kcmi.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&zcd=002001016&zno=1792&cno=6356					경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttld=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?nttld=10082072&menuNo=200690					증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10078655&menuNo=200690					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(수)	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	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	전월대비
2024.09.30	176.2	-8.4	-19.3
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, 메타결제원

단기금융시장 금리 추이

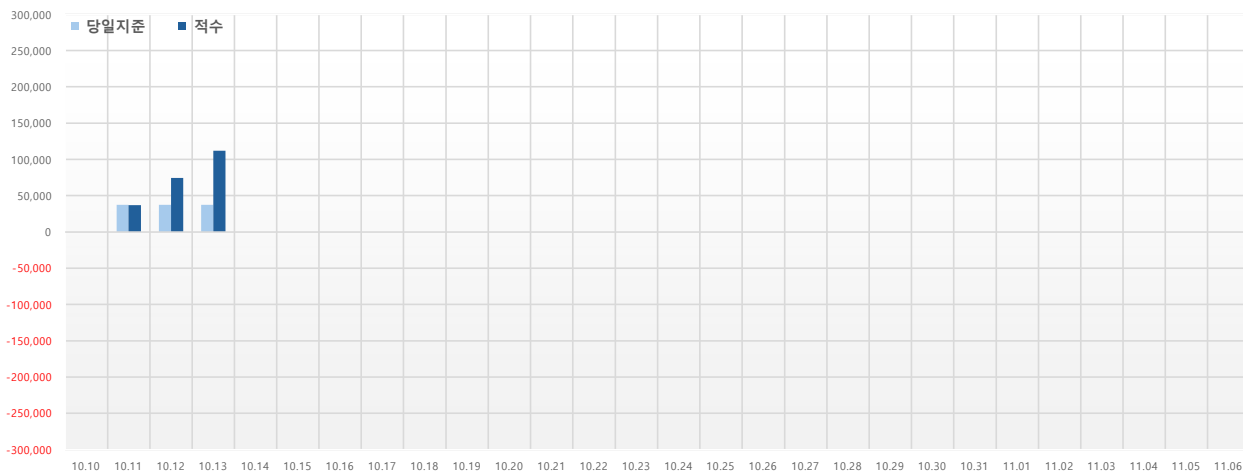


기준금리 추이				단위 : %P
2024년	2023년	2022년	2021년	
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금)	3.25% (▼0.25)	10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목)	3.50% (동결)	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	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	
10.10(목)	-309	-309
10.11(금)	37,373	37,051
10.12(토)	37,373	74,424
10.13(일)	37,373	111,797
10.14(월)		
10.15(화)		
10.16(수)		
10.17(목)		
10.18(금)		
10.19(토)		
10.20(일)		
10.21(월)		
10.22(화)		
10.23(수)		
10.24(목)		
10.25(금)		
10.26(토)		
10.27(일)		
10.28(월)		
10.29(화)		
10.30(수)		
10.31(목)		
11.01(금)		
11.02(토)		
11.03(일)		
11.04(월)		
11.05(화)		
11.06(수)		