

레포 시장동향

◎ 전일

공모주 청약자금 운용에 따른 유동성 확대 예상됐으나 시은 매수 감소하여 조달여건 개선되지 못함. 장 중 운용사 추가 자금 유입되어 수급 대체로 무난하였음.

◎ 금일

청약 환불 및 공자기금 환수 영향으로 조달금리 상승 예상됨. 행안부 재정 유입되어 지준 및 적수 흐름 양호하겠으나 금리 수준에 따라 은행권 움직임 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.10.23 (수)				2024.10.24 (목)					
재정 및 기타		38,000		한은RP매각 만기(7일)			20,000		
				재정증권 만기(63일)			10,000		
				재정 및 기타 (행안5.0)			61,000		
세입 및 기타		-28,000		한은RP매각(7일)			-30,000		
				통안채 발행(2년)			-6,000		
				공자기금 환수			-30,000		
				세입 및 기타			-15,000		
전일 기준	지준	12,384	적수	143,891	금일 예상	지준	22,000	적수	166,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.10.17(목)	223.4	198.6	3.25%	3.278%	3.269%	3.25%	3.39%	2.897%	2.946%
2024.10.18(금)	221.5	199.1	3.26%	3.278%	3.278%		3.39%	2.908%	2.971%
2024.10.21(월)	216.6	198.7	3.26%	3.264%	3.279%		3.39%	2.902%	2.963%
2024.10.22(화)	218.5	199.0	3.25%	3.264%	3.269%		3.40%	2.943%	3.014%
2024.10.23(수)	218.9		3.25%	3.270%	3.269%		3.40%	2.936%	3.011%

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
2024.10.17(목)	14:00~14:10	7	2024.10.24(목)	40.34	3.25%	2.00	5.0%	2024-054-007

◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정액	응찰금액	낙찰금리	낙찰액	회차번호
2024.10.02(수)	14:00~14:10	27	2024.10.29(화)	0.50	1.30	3.40%	0.50	2024-0036-0027
2024.10.15(화)	14:00~14:10	28	2024.11.12(화)	0.30	0.78	3.20%	0.30	2024-0038-0028
2024.10.22(화)	14:00~14:10	28	2024.11.19(화)	0.30	0.62	3.20%	0.30	2024-0039-0028

청약 정보

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사/인수사(증거금)
공모주	성우	이차전지 기업	2024.10.21(월) ~ 2024.10.22(화)	2024.10.24(목)	한투(9.8조)
공모주	유진스팩11호	기업인수목적회사	2024.10.22(화) ~ 2024.10.23(수)	2024.10.25(금)	유진(6,138억)
공모주	에이릭스	드론·로봇 에듀테크 전문 기업	2024.10.23(수) ~ 2024.10.24(목)	2024.10.28(월)	한투(459억)
공모주	탑런토탈솔루션	차량용 부품 제조 기업	2024.10.23(수) ~ 2024.10.24(목)	2024.10.28(월)	KB(866억)
공모주	에어레인	기체분리막 솔루션 전문 기업	2024.10.24(목) ~ 2024.10.25(금)	2024.10.29(화)	신영
공모주	에이치이엠파마	마이크로바이옴 헬스케어 기업	2024.10.24(목) ~ 2024.10.25(금)	2024.10.29(화)	신한
공모주	토모큐브	기타 광학기기 제조 기업	2024.10.28(월) ~ 2024.10.29(화)	2024.10.31(목)	대신증권
공모주	더본코리아(유가)	경영 컨설팅 기업	2024.10.28(월) ~ 2024.10.29(화)	2024.10.31(목)	한투, NH증권

관련 정보

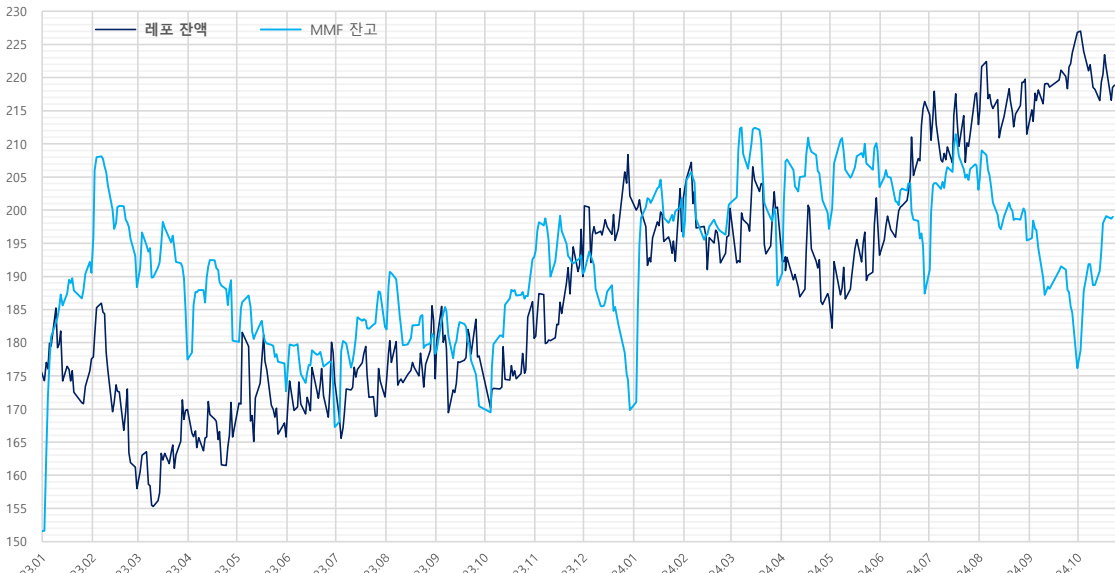
지준일	2024.11.06(수)	금통위	2024.11.28(목)	FOMC	2024.11.06(수) ~ 2024.11.07(목)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24)					www.kcmi.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&zcd=002001016&zno=17928&cno=6356	경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11)					www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlId=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?nttlId=10082072&menuNo=200690	증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)					www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlId=10078655&menuNo=200690	금융투자협회	https://kofiabond.or.kr

기준 계산-적립기간, 금통위 및 FOMC

	기준 계산기간		기준 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)	06.11(화)		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

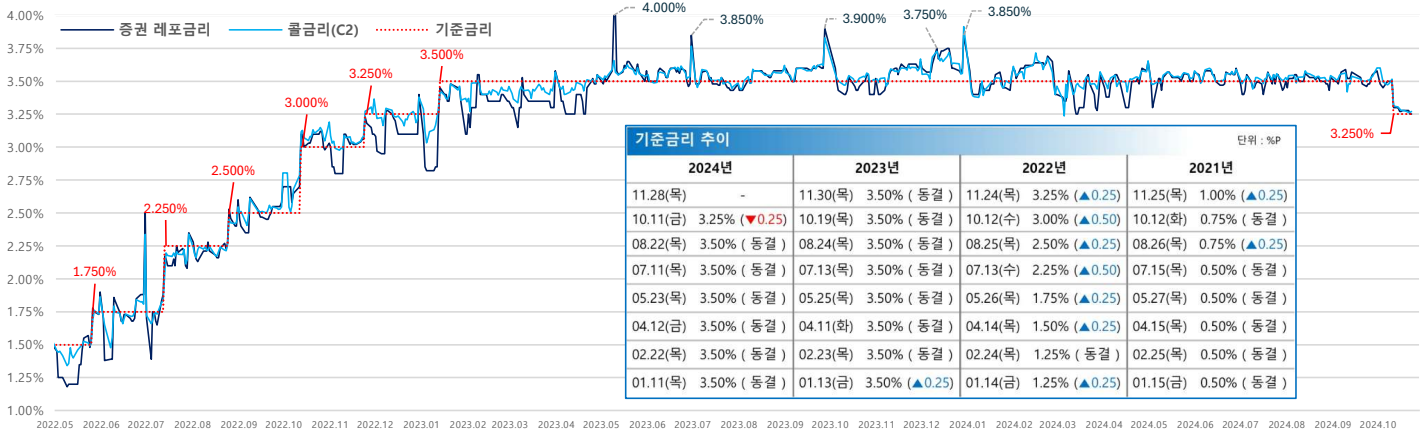
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전월대비	전전월대비
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, 예탁결제원

단기금융시장 금리 추이

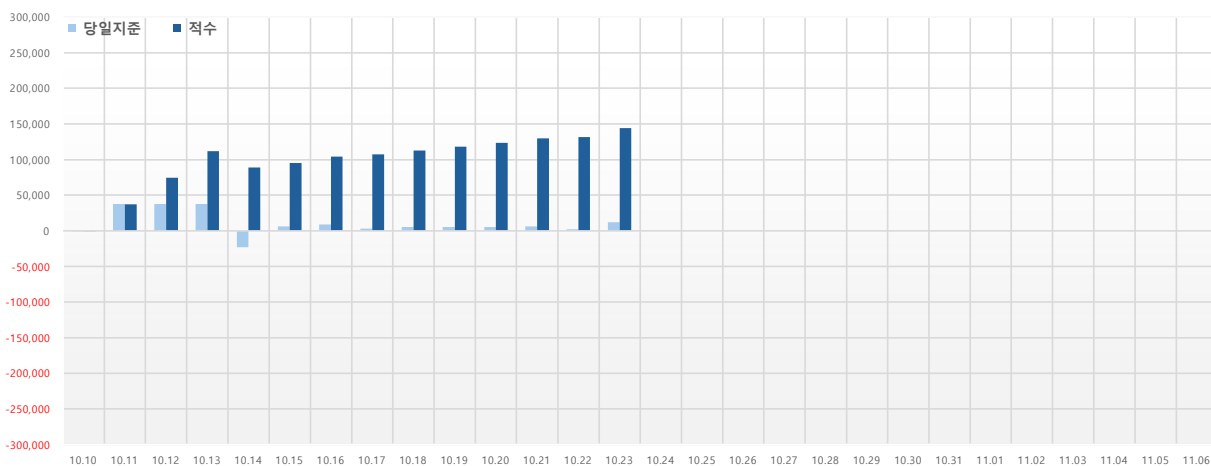


기준금리 추이				단위 : %P
2024년	2023년	2022년	2021년	
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금)	3.25% (▼0.25)	10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목)	3.50% (동결)	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	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

당일기준 및 적수 추이

단위 : 억 원



	당일기준	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)	-22,880	88,890
10.15(화)	6,262	95,151
10.16(수)	8,976	104,129
10.17(목)	3,160	107,302
10.18(금)	5,340	112,643
10.19(토)	5,340	117,983
10.20(일)	5,340	123,323
10.21(월)	6,212	129,539
10.22(화)	1,973	131,507
10.23(수)	12,384	143,891
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)		