

## 레포 시장동향

## ◎ 지난주

급여일 환매 영향으로 주초 운용사 및 신탁 매수 감소했음에도 조달여건 양호했으며, 주 중 공자기금 및 청약자금 유입되어 레포금리 기준금리 선을 횡보하였음. 은행권 양방향 움직임 혼재했으나 기준 및 적수 흐름 양호해 시은 조달보다 운용에 적극적이었음. 이에 따라 국고-통안 및 일반채 해소는 무난한 모습을 보임. 주 후반부로 갈수록 회사채 해소 쉽지 않았고, 차주 부가세 납부에 앞서 유동성 축소되어 조달금리 상승 전환하였음.

## ◎ 금일

부가세 납부에 따른 환매 영향으로 운용사 및 신탁 매수 감소하겠으며, 당일기준 잉여폭 축소되겠음. 시장 은행권 매수 의존도 높음 전망.

## 기준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2024.10.25 (금) |    |         |             | 2024.10.28 (월) |       |    |         |    |         |
|----------------|----|---------|-------------|----------------|-------|----|---------|----|---------|
| 국고채 조기환매       |    | 30,000  | 재정 및 기타     |                |       |    | 8,000   |    |         |
| 재정 및 기타        |    | 19,000  |             |                |       |    |         |    |         |
| 세입 및 기타        |    | -29,000 | 통안채 발행(91일) |                |       |    | -8,000  |    |         |
|                |    |         | 부가세 선납 및 기타 |                |       |    | -33,000 |    |         |
| 전일 기준          | 기준 | 47,724  | 적수          | 219,334        | 금일 예상 | 기준 | 15,000  | 적수 | 330,000 |

## Market Data

단위 : 조 원

|               | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리  | 콜금리(C2) | KOFR   | 기준금리  | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|-------|---------|---------|---------|
| 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   | 199.9  | 3.25% | 3.270%  | 3.269% | 3.25% | 3.40%   | 2.936%  | 3.011%  |
| 2024.10.24(목) | 219.8   | 198.8  | 3.26% | 3.276%  | 3.278% |       | 3.40%   | 2.891%  | 2.956%  |
| 2024.10.25(금) | 219.3   |        | 3.28% | 3.283%  | 3.296% |       | 3.40%   | 2.882%  | 2.941%  |

## 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         |
|---------------|-------------|----|---------------|-------|-------|------|------|--------------|
| 2024.10.24(목) | 14:00~14:10 | 7  | 2024.10.31(목) | 44.02 | 3.25% | 2.50 | 5.7% | 2024-055-007 |

## ◎ 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 | 에이릭스      | 드론-로봇 에듀테크 전문 기업 | 2024.10.23(수) ~ 2024.10.24(목) | 2024.10.28(월) | 한투(1.62조)    |
| 공모주 | 탑런토탈솔루션   | 차량용 부품 제조 기업     | 2024.10.23(수) ~ 2024.10.24(목) | 2024.10.28(월) | KB(5.54조)    |
| 공모주 | 에어레인      | 기체분리막 솔루션 전문 기업  | 2024.10.24(목) ~ 2024.10.25(금) | 2024.10.29(화) | 신영(1.44조)    |
| 공모주 | 에이치이엠파마   | 마이크로바이옴 헬스케어 기업  | 2024.10.24(목) ~ 2024.10.25(금) | 2024.10.29(화) | 신한(1.35조)    |
| 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     |

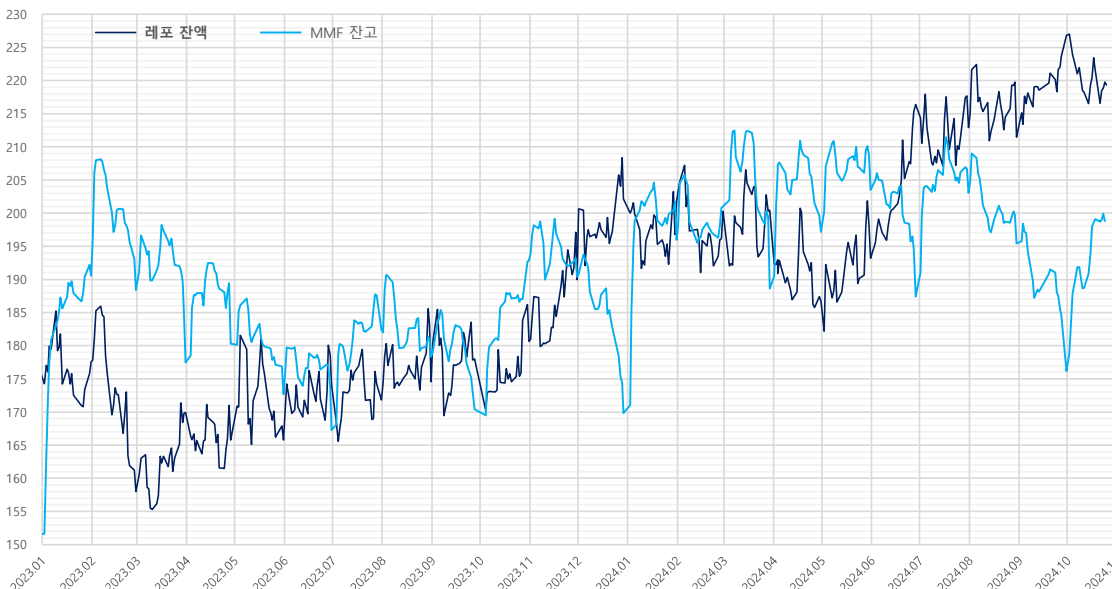
## 관련 정보

| 지준일   | 2024.11.06(수) | 금통위 | 2024.11.28(목) | FOMC | 2024.11.06(수) ~ 2024.11.07(목)  | 한국은행    | <a href="http://www.bok.or.kr">http://www.bok.or.kr</a>       |
|---|---------------|-----|---------------|------|--|---------|---|
| · 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24) |               |     |               |      | <a href="http://www.kcmi.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&amp;zcd=002001016&amp;zno=1792&amp;cno=6356">www.kcmi.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&amp;zcd=002001016&amp;zno=1792&amp;cno=6356</a> | 경제통계시스템 | <a href="https://ecos.bok.or.kr">https://ecos.bok.or.kr</a>   |
| · 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11)           |               |     |               |      | <a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlid=10084595&amp;menuNo=200295">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlid=10084595&amp;menuNo=200295</a>   | 무위험지표금리 | <a href="https://www.kofr.kr">https://www.kofr.kr</a>         |
| · 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)               |               |     |               |      | <a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=10082072&amp;menuNo=200690">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=10082072&amp;menuNo=200690</a>   | 증권정보포털  | <a href="https://seibro.or.kr">https://seibro.or.kr</a>       |
| · 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)                           |               |     |               |      | <a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=10078655&amp;menuNo=200690">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=10078655&amp;menuNo=200690</a>   | 금융투자협회  | <a href="https://kofiabond.or.kr">https://kofiabond.or.kr</a> |

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) |          |                     |
| 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

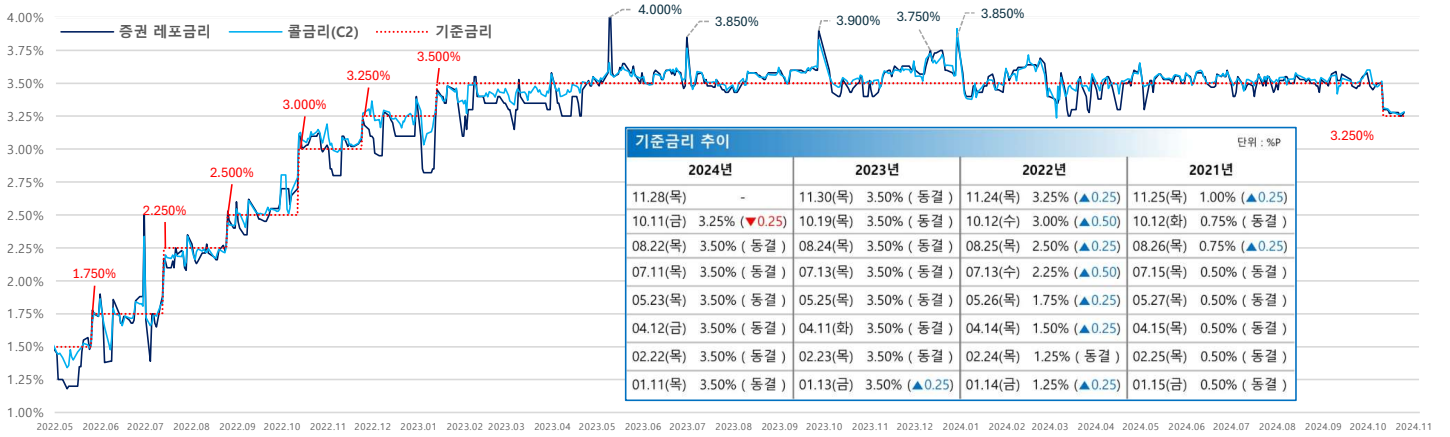


단위 : 조 원

| 해당연월       | MMF   | 전월대비  | 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, 예탁결제원

단기금융시장 금리 추이

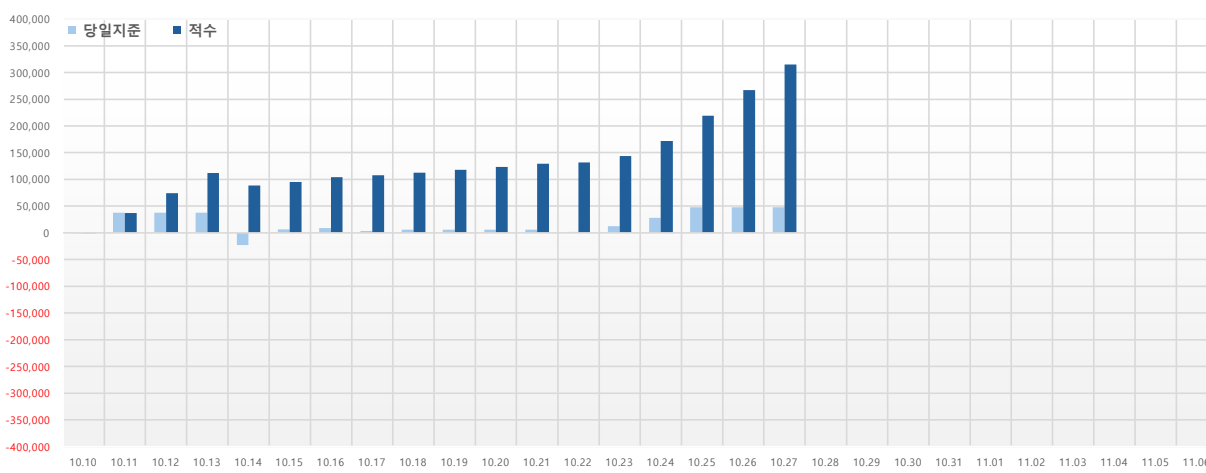


기준금리 추이

| 단위 : %P  |               |                        |                        |
|----------|---------------|------------------------|------------------------|
| 2024년    | 2023년         | 2022년                  | 2021년                  |
| 11.28(목) | -             | 11.30(목) 3.50% (동결)    | 11.24(목) 3.25% (▲0.25) |
| 10.11(금) | 3.25% (▼0.25) | 10.19(목) 3.50% (동결)    | 10.12(수) 3.00% (▲0.50) |
| 08.22(목) | 3.50% (동결)    | 08.24(목) 3.50% (동결)    | 08.26(목) 0.75% (동결)    |
| 07.11(목) | 3.50% (동결)    | 07.13(목) 3.50% (동결)    | 07.13(수) 2.25% (▲0.50) |
| 05.23(목) | 3.50% (동결)    | 05.25(목) 3.50% (동결)    | 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) |
| 02.22(목) | 3.50% (동결)    | 02.23(목) 3.50% (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) |

자료 : 한국은행

당일지준 및 적수 추이



단위 : 억 원

| 당일지준     | 적수      |
|----------|---------|
| 10.10(목) | -309    |
| 10.11(금) | 37,373  |
| 10.12(토) | 37,373  |
| 10.13(일) | 37,373  |
| 10.14(월) | -22,880 |
| 10.15(화) | 6,262   |
| 10.16(수) | 8,976   |
| 10.17(목) | 3,160   |
| 10.18(금) | 5,340   |
| 10.19(토) | 5,340   |
| 10.20(일) | 5,340   |
| 10.21(월) | 6,212   |
| 10.22(화) | 1,973   |
| 10.23(수) | 12,384  |
| 10.24(목) | 27,991  |
| 10.25(금) | 47,724  |
| 10.26(토) | 47,724  |
| 10.27(일) | 47,724  |
| 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) |         |