

레포 시장동향

◎ 전일

금리 소폭 상승 출발한 가운데 장 초반 시은 저금리 탐색하며 조달에 신중한 모습이었음. 장 중 추가자금 유입 크지 않아 일시적인 조달 정체를 보였음.

◎ 금일

조달여건 전일과 비슷할 것으로 기대되며, 행안부 재정 유입되어 당일기준 잉여 전환 예상됨. 주말 전 은행권 양방향 움직임에 따라 분위기 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2024.05.23 (목) | | | | 2024.05.24 (금) | | | | |
|-------------------------|----|---------|----|----------------|----|--------|--------|----------|
| 한은RP매각 만기(7일) | | 2,000 | | 재정(행안부) 및 기타 | | | 68,000 | |
| 재정증권 만기(63일) | | 20,000 | | | | | | |
| 재정 및 기타 | | 20,000 | | | | | | |
| 한은RP매각(7일) | | -2,000 | | 세입 및 기타 | | | -7,000 | |
| 통안채 발행(2년), 모집금리 3.445% | | -5,000 | | | | | | |
| 통안채 발행(3년), 모집금리 3.455% | | -2,000 | | | | | | |
| 재정증권 발행(63일) | | -20,000 | | | | | | |
| 세입 및 기타 | | -10,000 | | | | | | |
| 전일 기준 | 지준 | -31,123 | 적수 | 금일 예상 | 지준 | 30,000 | 적수 | -340,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2024.05.17(금) | 195.6 | 208.1 | 3.53% | 3.534% | 3.548% | 3.500% | 3.60% | 3.379% | 3.413% |
| 2024.05.20(월) | 192.2 | 208.6 | 3.53% | 3.539% | 3.549% | | 3.60% | 3.412% | 3.444% |
| 2024.05.21(화) | 195.1 | 208.0 | 3.52% | 3.531% | 3.539% | | 3.60% | 3.411% | 3.441% |
| 2024.05.22(수) | 196.7 | 210.0 | 3.50% | 3.531% | 3.523% | | 3.60% | 3.409% | 3.436% |
| 2024.05.23(목) | 189.4 | | 3.53% | 3.556% | 3.550% | | 3.60% | 3.402% | 3.421% |

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

| | | | | | | | | | |
|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 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) | 2022.11.24(목) | 3.25% (▲0.25) |
| 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) | 2022.10.12(수) | 3.00% (▲0.50) |
| 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) | 2022.08.25(목) | 2.50% (▲0.25) |

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매각

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 응찰액 | 금리 | 낙찰액 | 낙찰률 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|-------|------|------|--------------|
| 2024.05.23(목) | 14:00~14:10 | 7 | 2024.05.30(목) | 2.12 | 3.50% | 0.20 | 9.4% | 2024-028-007 |

◎ 통화안정계정예치금

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 2024.04.30(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.05.28(화) | 0.10 | 0.24 | 3.48% | 0.10 | 2024-0018-0028 |
| 2024.05.14(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.06.11(화) | 0.10 | 0.20 | 3.48% | 0.10 | 2024-0019-0028 |
| 2024.05.21(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.06.18(화) | 0.10 | 0.35 | 3.48% | 0.10 | 2024-0020-0028 |

청약 정보

| 구분 | 청약명 | 업체 | 모집일 | 환불일 | 주간사 / 인수사 (증거금) |
|-----|--------|---------------|-------------------------------|---------------|-----------------|
| 공모주 | 에이치브이엠 | 첨단금융 제조 전문 기업 | 2024.05.30(목) ~ 2024.05.31(금) | 2024.06.04(화) | NH |

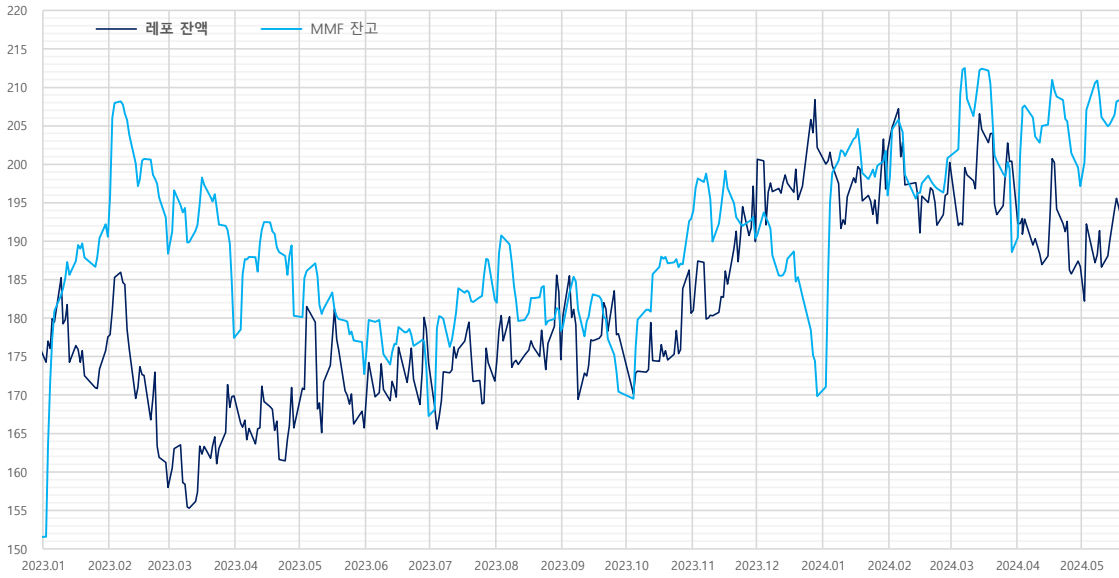
관련 정보

| | | | | | | | |
|--|---------------|-----|--|------|-------------------------------|---------|---|
| 지준일 | 2024.06.05(수) | 금통위 | 2024.07.11(목) | FOMC | 2024.06.11(화) ~ 2024.06.12(수) | 한국은행 | http://www.bok.or.kr |
| · 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호 | | | | | | 경제통계시스템 | https://ecos.bok.or.kr |
| · 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25) | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=10082072&menuNo=200690 | | | 무위험지표금리 | https://www.kofr.kr |
| · 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27) | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=10078655&menuNo=200690 | | | 증권정보포털 | https://seibro.or.kr |
| · 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판) | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttlid=10068266&menuNo=200460 | | | 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) | | 02.08(목) | 09.26(목) | 09.17(화) ~ 09.18(수) |
| 2024년 10월 | 10.01(화) | 10.31(금) | 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 | 전월대비 |
| 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

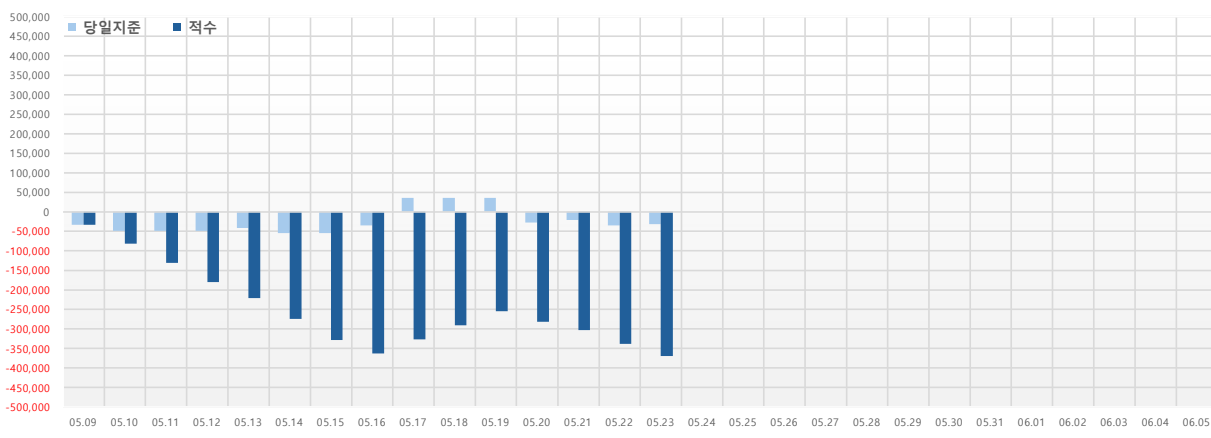
단기금융시장 금리 추이



| 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) | - | 08.24(목) 3.50% (동결) | 08.25(목) 2.50% (▲0.25) | 08.26(목) 0.75% (▲0.25) |
| 07.11(목) | - | 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 | |
|----------|---------|----------|
| 05.09(목) | -32,903 | -32,903 |
| 05.10(금) | -48,862 | -81,765 |
| 05.11(토) | -48,862 | -130,627 |
| 05.12(일) | -48,862 | -179,489 |
| 05.13(월) | -41,393 | -220,903 |
| 05.14(화) | -54,181 | -274,633 |
| 05.15(수) | -54,181 | -328,814 |
| 05.16(목) | -35,066 | -363,425 |
| 05.17(금) | 36,254 | -327,174 |
| 05.18(토) | 36,254 | -290,920 |
| 05.19(일) | 36,254 | -254,666 |
| 05.20(월) | -27,618 | -282,287 |
| 05.21(화) | -21,172 | -303,459 |
| 05.22(수) | -34,884 | -338,343 |
| 05.23(목) | -31,123 | -369,469 |
| 05.24(금) | | |
| 05.25(토) | | |
| 05.26(일) | | |
| 05.27(월) | | |
| 05.28(화) | | |
| 05.29(수) | | |
| 05.30(목) | | |
| 05.31(금) | | |
| 06.01(토) | | |
| 06.02(일) | | |
| 06.03(월) | | |
| 06.04(화) | | |
| 06.05(수) | | |