

레포 시장동향

◎ 전일

월말 직전임에도 조달여건 양호했으며, 은행권 매도 꾸준하여 잉여 자금 해소 원활하였음. 장 중 추가 자금 일부 저금리 매칭됐으나 그 규모는 크지 않았음.

◎ 금일

운용사 및 신탁 유동성 풍부하여 수급 무난할 것으로 예상됨. 은행권 적수 관리를 위한 콜-레포 조달 계속되겠으나 금리에 따라 매도 규모 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.05.29 (수)				2024.05.30 (목)			
재정 및 기타		22,000		한은RP매각 만기(7일)			2,000
				재정증권 만기(63일)			20,000
				재정 및 기타			12,000
세입 및 기타		-22,000		한은RP매각(8일)			-4,000
				재정증권 발행(63일)			-20,000
				세입 및 기타			-13,000
전일 기준	지준	44,200	적수	-135,513	금일 예상	지준	41,000
						적수	-94,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.05.23(목)	189.4	207.0	3.53%	3.556%	3.550%	3.500%	3.60%	3.402%	3.421%
2024.05.24(금)	190.2	206.8	3.56%	3.565%	3.576%		3.60%	3.423%	3.451%
2024.05.27(월)	190.7	206.1	3.55%	3.555%	3.567%		3.61%	3.413%	3.439%
2024.05.28(화)	197.9	209.4	3.50%	3.520%	3.522%		3.62%	3.394%	3.421%
2024.05.29(수)	201.9		3.50%	3.523%	3.521%		3.61%	3.425%	3.465%

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
2024.05.14(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
2024.05.28(화)	14:00~14:10	28	2024.06.25(화)	0.20	0.35	3.48%	0.20	2024-0021-0028

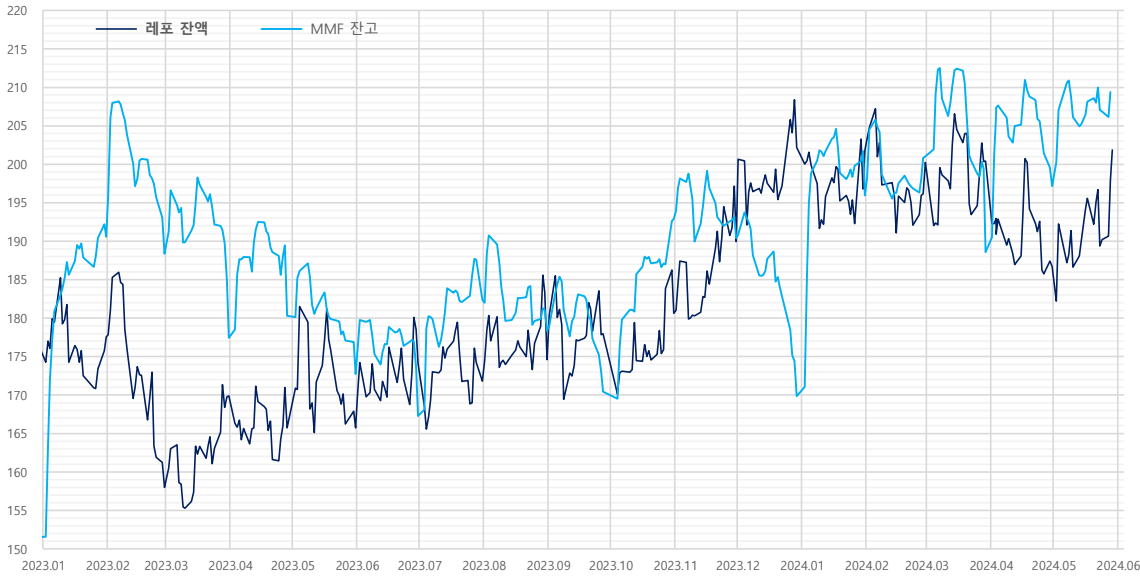
관련 정보

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 최소증거금을 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)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						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(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	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	168.8	-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

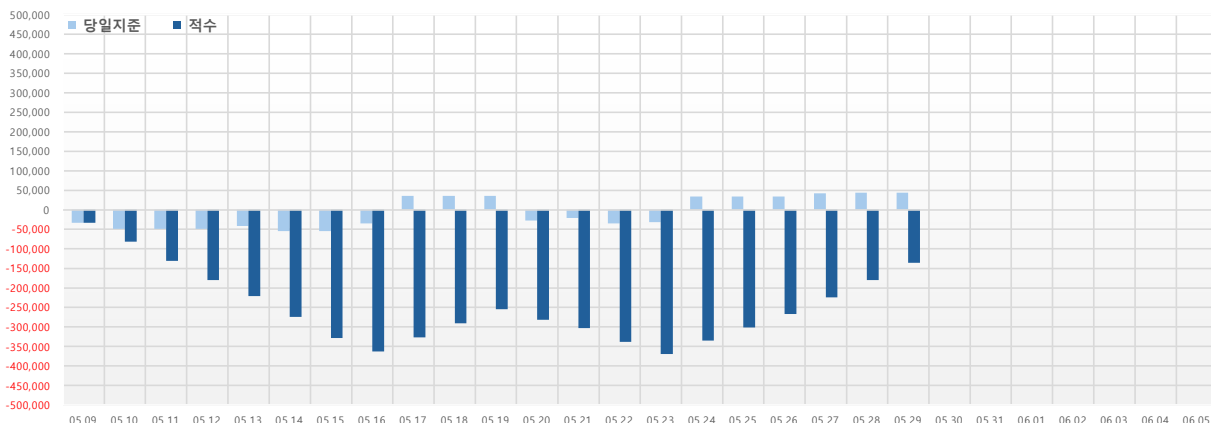


기준금리 추이

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)	-	10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)
08.22(금)	-	08.24(목) 3.50% (동결)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	-	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)	05.26(목) 1.75% (▲0.25)
04.12(금)	3.50% (동결)	04.11(화) 3.50% (동결)	04.15(목) 0.50% (동결)
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)
		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
05.10(금)	-48,862
05.11(토)	-48,862
05.12(일)	-48,862
05.13(월)	-41,393
05.14(화)	-54,181
05.15(수)	-54,181
05.16(목)	-35,066
05.17(금)	36,254
05.18(토)	36,254
05.19(일)	36,254
05.20(월)	-27,618
05.21(화)	-21,172
05.22(수)	-34,884
05.23(목)	-31,123
05.24(금)	34,085
05.25(토)	34,085
05.26(일)	34,085
05.27(월)	42,654
05.28(화)	44,349
05.29(수)	44,200
05.30(목)	
05.31(금)	
06.01(토)	
06.02(일)	
06.03(월)	
06.04(화)	
06.05(수)	