

레포 시장동향

◎ 전일

은행권 매수세 강한 가운데 청약자금 운용되어 조달여건 양호하였음. 시은 저금리 매도 대기했으나 매칭 제한적이었으며, 분기말 대비 기일물 수요 증가하였음.

◎ 금일

당일기준 크게 개선되어 은행권 매수 꾸준하겠으며, 청약 환불 및 MMF 환매 영향 제한적이겠음. 일반채 해소 무난하겠으나 회사채 정체는 지속될 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2024.06.26 (수) | | | | 2024.06.27 (목) | | | |
|----------------|----|---------|----|-------------------------------|-------|----|----------|
| 공자기금 | | 7,000 | | 한은RP매각 만기(7일) | | | 30,000 |
| 재정 및 기타 | | 37,000 | | 재정증권 만기(63일) | | | 20,000 |
| | | | | 재정 및 기타 | | | 77,000 |
| 국고채 발행(20년) | | -7,000 | | 한은RP매각(7일) | | | -10,000 |
| 세입 및 기타 | | -20,000 | | 통안채 발행(2년, 모집금리(시장수익률) 3.305% | | | -4,000 |
| | | | | 통안채 발행(3년, 모집금리(시장수익률) 3.310% | | | -3,000 |
| | | | | 공자기금 환수 | | | -2,000 |
| | | | | 재정증권 발행(63일) | | | -20,000 |
| | | | | 세입 및 기타 | | | -17,000 |
| 전일 기준 | 지준 | 42,780 | 적수 | -1,012,449 | 금일 예상 | 지준 | 114,000 |
| | | | | | | 적수 | -899,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2024.06.20(목) | 211.0 | 199.8 | 3.48% | 3.519% | 3.507% | 3.500% | 3.60% | 3.196% | 3.220% |
| 2024.06.21(금) | 205.2 | 198.5 | 3.57% | 3.560% | 3.586% | | 3.60% | 3.176% | 3.199% |
| 2024.06.24(월) | 207.8 | 198.3 | 3.55% | 3.554% | 3.567% | | 3.60% | 3.194% | 3.215% |
| 2024.06.25(화) | 207.4 | 195.7 | 3.57% | 3.575% | 3.586% | | 3.60% | 3.201% | 3.217% |
| 2024.06.26(수) | 212.8 | | 3.55% | 3.552% | 3.565% | | 3.60% | 3.215% | 3.230% |

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

| | | | | | | | | | |
|---------------|------------|---------------|------------|---------------|------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 2024.05.23(목) | 3.50% (동결) | 2024.01.11(목) | 3.50% (동결) | 2023.08.24(목) | 3.50% (동결) | 2023.04.11(화) | 3.50% (동결) | 2022.11.24(목) | 3.25% (▲0.25) |
| 2024.04.12(금) | 3.50% (동결) | 2023.11.30(목) | 3.50% (동결) | 2023.07.13(목) | 3.50% (동결) | 2023.02.23(목) | 3.50% (동결) | 2022.10.12(수) | 3.00% (▲0.50) |
| 2024.02.22(목) | 3.50% (동결) | 2023.10.19(목) | 3.50% (동결) | 2023.05.25(목) | 3.50% (동결) | 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 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|-------|------|-------|--------------|
| 2024.06.20(목) | 14:00~14:10 | 7 | 2024.06.27(목) | 8.72 | 3.50% | 3.00 | 34.4% | 2024-034-007 |

◎ 통화안정계정예치금

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 2024.06.11(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.07.09(화) | 0.10 | 0.10 | 3.51% | 0.10 | 2024-0022-0028 |
| 2024.06.18(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.07.16(화) | 0.30 | 0.59 | 3.48% | 0.30 | 2024-0023-0028 |
| 2024.06.25(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.07.23(화) | 0.10 | 0.18 | 3.48% | 0.10 | 2024-0024-0028 |

청약 정보

| 구분 | 청약명 | 업체 | 모집일 | 환불일 | 주공사/인수사(증거금) |
|-----|------------|--------------|-------------------------------|---------------|---------------|
| 공모주 | 하스 | 치과 소재 제조 기업 | 2024.06.24(월) ~ 2024.06.25(화) | 2024.06.27(목) | 삼성(7.7조) |
| 실권주 | 에이프로젠바이오로직 | 의약품 제조 기업 | 2024.06.24(월) ~ 2024.06.25(화) | 2024.06.27(목) | 한투, 상상인(112억) |
| 실권주 | 한주라이트메탈 | 알루미늄 소재 전문기업 | 2024.06.25(화) ~ 2024.06.26(수) | 2024.06.28(금) | KB(16억) |
| 실권주 | 삼보산업 | 알루미늄 소재 전문기업 | 2024.06.25(화) ~ 2024.06.26(수) | 2024.06.28(금) | 한투 |

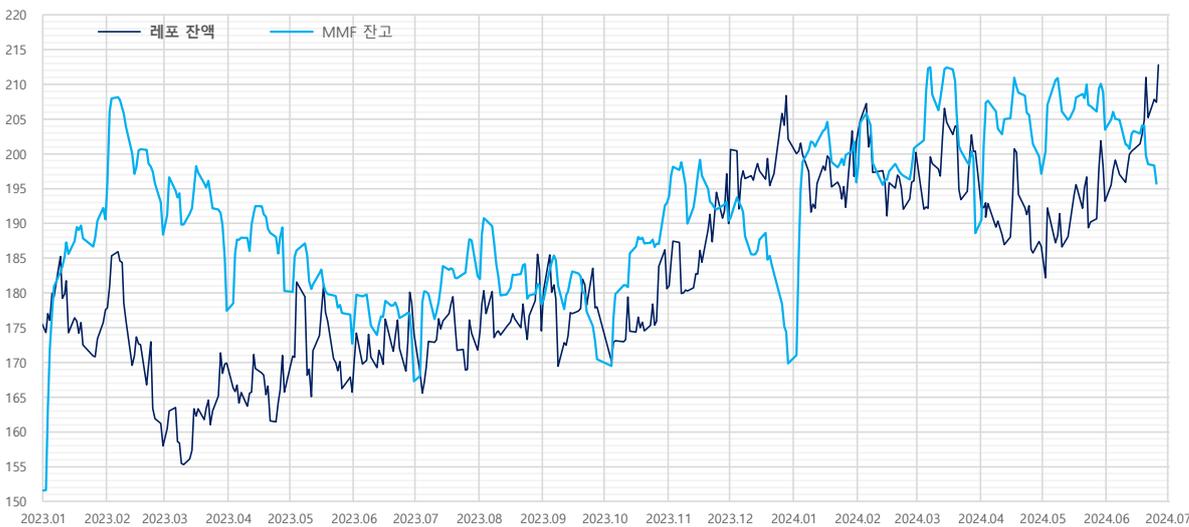
관련 정보

| 지준일 | 2024.07.10(수) | 금통위 | 2024.07.11(목) | FOMC | 2024.07.30(화) ~ 2024.07.31(수) | 한국은행 | http://www.bok.or.kr |
|---|---------------|-----|---------------|--|-------------------------------|---------|---|
| 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11) | | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttid=10084595&menuNo=200295 | | 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?nttid=10082072&menuNo=200690 | | 무위험지표금리 | https://www.kofr.kr |
| 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27) | | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10078655&menuNo=200690 | | 증권정보포털 | https://seibro.or.kr |
| 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판) | | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttid=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) | | 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) | | 09.17(화) ~ 09.18(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) | 11.06(수) ~ 11.07(목) |
| 2024년 10월 | 10.01(화) | 10.31(목) | 11.07(목) | 12.11(수) | 10.11(금) | 10.31(목) | | 12.17(화) ~ 12.18(수) |
| 2024년 11월 | 11.01(금) | 11.30(토) | 12.12(목) | 2025.01.08(수) | 11.28(목) | 11.14(목) | | |
| 2024년 12월 | 12.01(일) | 12.31(화) | 2025.01.09(목) | 2025.02.05(수) | | 12.12(목) | 12.24(화) | |

레포 거래잔액 및 MMF 잔고 추이



단위 : 조 원

| 해당연월 | MMF | 전일대비 | 전월대비 |
|------------|-------|-------|-------|
| 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, 메릭경제원

단기금융시장 금리 추이



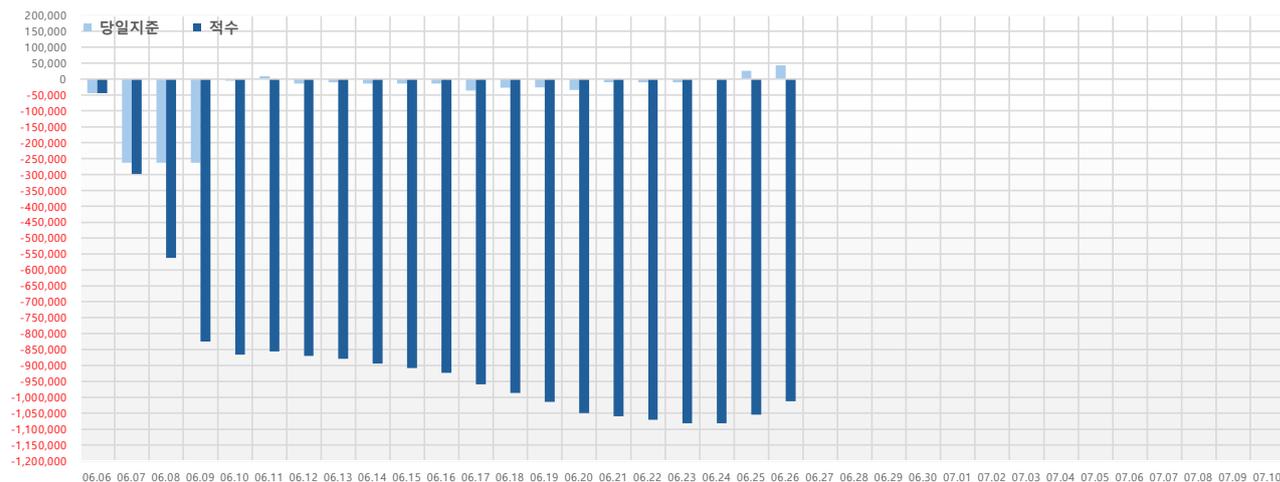
기준금리 추이

| 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(금) | 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) |

단위 : %P

자료 : 한국은행

당일지준 및 적수 추이



단위 : 억 원

| 당일지준 | 적수 | |
|----------|----------|------------|
| 06.06(목) | -44,637 | -44,637 |
| 06.07(금) | -263,452 | -298,158 |
| 06.08(토) | -263,452 | -561,610 |
| 06.09(일) | -263,452 | -825,062 |
| 06.10(월) | -4,883 | -865,329 |
| 06.11(화) | 9,237 | -856,089 |
| 06.12(수) | -13,965 | -870,053 |
| 06.13(목) | -9,488 | -879,549 |
| 06.14(금) | -14,516 | -894,067 |
| 06.15(토) | -14,516 | -908,583 |
| 06.16(일) | -14,516 | -923,099 |
| 06.17(월) | -36,366 | -959,467 |
| 06.18(화) | -28,040 | -986,826 |
| 06.19(수) | -26,311 | -1,014,509 |
| 06.20(목) | -34,483 | -1,049,001 |
| 06.21(금) | -10,932 | -1,059,929 |
| 06.22(토) | -10,932 | -1,070,861 |
| 06.23(일) | -10,932 | -1,081,793 |
| 06.24(월) | 379 | -1,081,442 |
| 06.25(화) | 26,229 | -1,055,210 |
| 06.26(수) | 42,780 | -1,012,449 |
| 06.27(목) | | |
| 06.28(금) | | |
| 06.29(토) | | |
| 06.30(일) | | |
| 07.01(월) | | |
| 07.02(화) | | |
| 07.03(수) | | |
| 07.04(목) | | |
| 07.05(금) | | |
| 07.06(토) | | |
| 07.07(일) | | |
| 07.08(월) | | |
| 07.09(화) | | |
| 07.10(수) | | |