

레포 시장동향

◎ 전일

건보 및 공자기금 유입 이어져 잉여세 강하게 출발했으나 장 중 일부 시은 시작금리 조달에 나서 오후께 수급 빠듯한 분위기로 전환되었음.

◎ 금일

시장 유동성 풍부하나 전일 오후의 타이트했던 장세 반영되어 금리 소폭 상승 예상됨. 은행권 조달 강도에 따라 수급 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2024.07.16 (화) | | | | 2024.07.17 (수) | | | | | |
|---------------------------|----|---------|---------|----------------|-------|---------|-------|----|---------|
| 통안계정 만기(28일) | | 3,000 | 재정 및 기타 | | | 8,000 | | | |
| 통안채 만기(91일) | | 7,000 | | | | | | | |
| 공자기금 | | 24,000 | | | | | | | |
| 재정 및 기타 | | 35,000 | | | | | | | |
| 통안계정(28일) | | -5,600 | 세입 및 기타 | | | -13,000 | | | |
| 통안계정(7일) | | -12,000 | | | | | | | |
| 통안채 발행(91일), 낙찰할인율 3.250% | | -5,700 | | | | | | | |
| 국고채 발행(10년) | | -24,000 | | | | | | | |
| 세입 및 기타 | | -13,000 | | | | | | | |
| 전일 기준 | 지준 | 13,462 | 적수 | -98,576 | 금일 예상 | 지준 | 8,000 | 적수 | -90,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2024.07.10(수) | 208.6 | 203.3 | 3.45% | 3.475% | 3.488% | 3.500% | 3.55% | 3.120% | 3.131% |
| 2024.07.11(목) | 207.6 | 205.5 | 3.48% | 3.528% | 3.503% | | 3.55% | 3.163% | 3.178% |
| 2024.07.12(금) | 209.6 | 206.5 | 3.50% | 3.528% | 3.520% | | 3.55% | 3.101% | 3.117% |
| 2024.07.15(월) | 207.1 | 205.8 | 3.48% | 3.509% | 3.501% | | 3.54% | 3.076% | 3.103% |
| 2024.07.16(화) | 214.3 | | 3.40% | 3.483% | 3.426% | | 3.55% | 3.035% | 3.061% |

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

| | | | | | | | | | |
|---------------|------------|---------------|------------|---------------|------------|---------------|------------|---------------|---------------|
| 2024.07.11(목) | 3.50% (동결) | 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) |
| 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) |

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매각

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 응찰액 | 금리 | 낙찰액 | 낙찰률 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|-------|-------|------|-------|--------------|
| 2024.07.11(목) | 14:00~14:10 | 7 | 2024.07.18(목) | 54.45 | 3.50% | 7.00 | 12.9% | 2024-037-007 |

◎ 통화안정계정예치금

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 2024.06.25(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.07.23(화) | 0.10 | 0.18 | 3.48% | 0.10 | 2024-0024-0028 |
| 2024.07.02(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.07.30(화) | 0.50 | 1.69 | 3.45% | 0.50 | 2024-0025-0028 |
| 2024.07.16(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2024.08.13(화) | 0.50 | 1.65 | 3.45% | 0.56 | 2024-0026-0028 |
| | 14:30~14:40 | 28 | 2024.07.23(화) | 1.00 | 2.77 | 3.48% | 1.20 | 2024-0027-0007 |

청약 정보

| 구분 | 청약명 | 업체 | 모집일 | 환불일 | 주간사/인수사(증거금) |
|-----|-----------|------------------|-------------------------------|---------------|--------------|
| 공모주 | SK증권스팩13호 | 기업인수목적회사 | 2024.07.15(월) ~ 2024.07.16(화) | 2024.07.18(목) | SK(1.65조) |
| 공모주 | NH스팩31호 | 기업인수목적회사 | 2024.07.16(화) ~ 2024.07.17(수) | 2024.07.19(금) | NH(706억) |
| 공모주 | 산일전기 | 특수법양기 전문기업 | 2024.07.18(목) ~ 2024.07.19(금) | 2024.07.23(화) | 미래, 삼성 |
| 실권주 | 퀀타스반도체 | IP(설계자산) 개발 전문기업 | 2024.07.18(목) ~ 2024.07.19(금) | 2024.07.23(화) | NH |

관련 정보

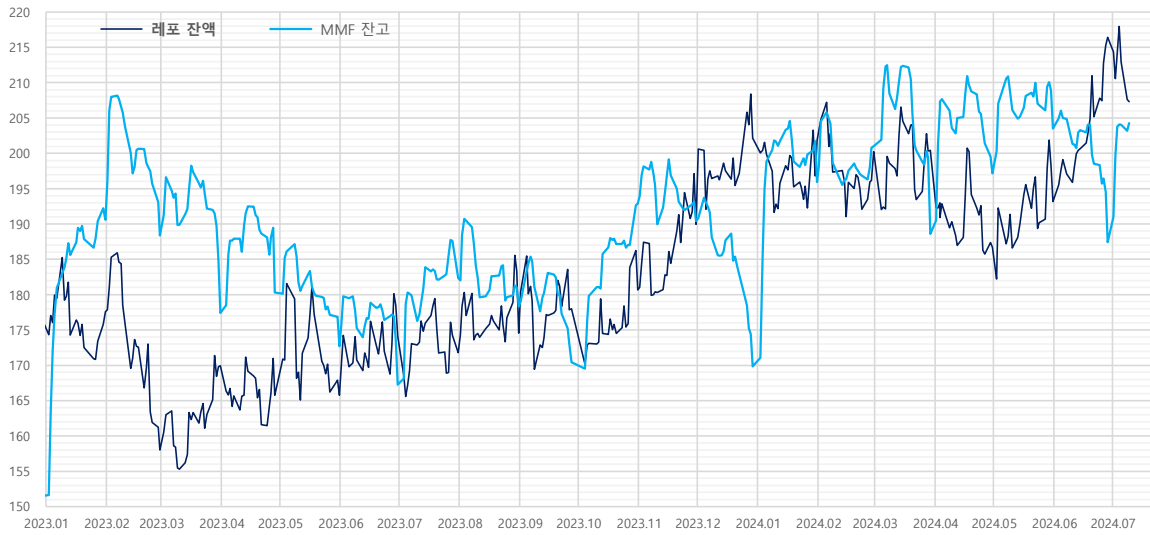
| 지준일 | 2024.08.07(수) | 금통위 | 2024.08.22(목) | FOMC | 2024.07.30(화) ~ 2024.07.31(수) | 한국은행 | http://www.bok.or.kr |
|---|---------------|-----|---------------|------|-------------------------------|---------|--|
| · 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24) | | | | | | | www.kcmti.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&zcd=002001016&zno=1792&cno=6356 |
| · 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11) | | | | | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttld=10084595&menuNo=200295 |
| · 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25) | | | | | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10082072&menuNo=200690 |
| · 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27) | | | | | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10078655&menuNo=200690 |
| | | | | | | 경제통계시스템 | https://ecos.bok.or.kr |
| | | | | | | 무위험지표금리 | https://www.kofr.kr |
| | | | | | | 증권정보포털 | https://seibro.or.kr |
| | | | | | | 금융투자협회 | https://kofiafond.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) | | 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

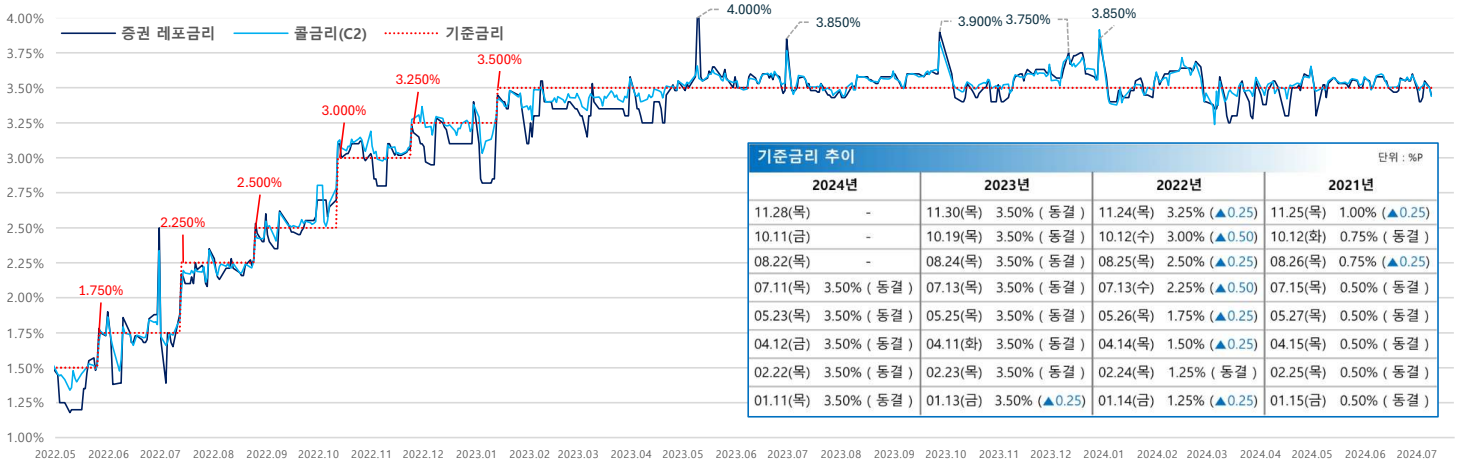
단위 : 조 원



| 해당연월 | MMF | 전월대비 | 전월대비 |
|------------|-------|-------|-------|
| 2024.06.28 | 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, 메타결제원

단기금융시장 금리 추이

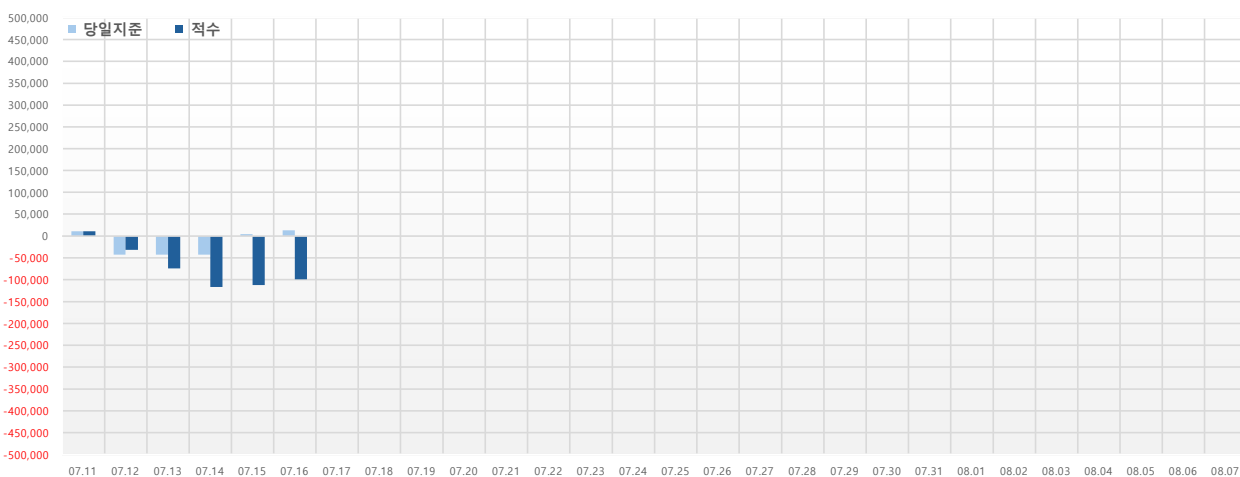


| 기준금리 추이 | | | | 단위 : %P | | | |
|----------|------------|----------|---------------|----------|---------------|----------|---------------|
| 2024년 | 2023년 | 2022년 | 2021년 | 2024년 | 2023년 | 2022년 | 2021년 |
| 11.28(목) | - | 11.30(목) | 3.50% (동결) | 11.24(목) | 3.25% (▲0.25) | 11.25(목) | 1.00% (▲0.25) |
| 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) | 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

당일지준 및 적수 추이

단위 : 억 원



| | 당일지준 | 적수 |
|----------|---------|----------|
| 07.11(목) | 10,783 | 10,783 |
| 07.12(금) | -42,427 | -31,643 |
| 07.13(토) | -42,427 | -74,070 |
| 07.14(일) | -42,427 | -116,497 |
| 07.15(월) | 4,464 | -112,029 |
| 07.16(화) | 13,462 | -98,576 |
| 07.17(수) | | |
| 07.18(목) | | |
| 07.19(금) | | |
| 07.20(토) | | |
| 07.21(일) | | |
| 07.22(월) | | |
| 07.23(화) | | |
| 07.24(수) | | |
| 07.25(목) | | |
| 07.26(금) | | |
| 07.27(토) | | |
| 07.28(일) | | |
| 07.29(월) | | |
| 07.30(화) | | |
| 07.31(수) | | |
| 08.01(목) | | |
| 08.02(금) | | |
| 08.03(토) | | |
| 08.04(일) | | |
| 08.05(월) | | |
| 08.06(화) | | |
| 08.07(수) | | |