

## Repo Market Report

2024. 1. 31 (수)



자금시장부 6021-5832

## 레포 시장동향

## ◎ 전일

청약 환불 및 국고 환수에 따른 자금 경색 우려 증대되어 금리 급등했으나 조달금리 부담으로 시은 매도 감소하여 수급 대체로 무난하였음.

## ◎ 금일

국고 환수 계속되는 가운데 MMF 한매 영향으로 조달금리 추가 상승 예상됨. 운용사 및 신탁 매수 감소하겠으며, 월말 은행권 양방향 움직임 일시적으로 축소될 전망.

## 지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.01.30 (화)				2024.01.31 (수)					
통안계정 만기(28일)		8,400	공자기금			8,000			
통안채 만기(91일)		10,000	재정 [행안부1.3   국세환급0.2   실시간2.0]			35,000			
공자기금		38,000	자금조정예금 만기			4,000			
재정 [인사처1.1   교육부0.9   국세환급0.3   실시간2.0]		43,000							
자금조정예금 만기		3,000							
기타		2,000							
통안계정(28일)		-2,000	국고여유자금 환수			-26,000			
통안채 발행(91일), 낙찰수익률 3.400%   낙찰할인율 3.372%		-10,000	세입			-16,000			
국고채 발행(30년)		-38,000	화폐 발행			-8,000			
국고여유자금 환수		-32,000	자금조정예금			-4,000			
세입		-8,000							
화폐발행		-8,000							
자금조정예금		-4,000							
전일 기준	지준	-21,531	적수	-39,886	금일 예상	지준	-28,000	적수	-68,000

## Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.01.24(수)	193.5	199.3	3.45%	3.449%	3.469%	3.500%	3.68%	3.300%	3.343%
2024.01.25(목)	195.3	198.4	3.45%	3.460%	3.474%		3.68%	3.313%	3.361%
2024.01.26(금)	192.3	199.8	3.45%	3.504%	3.480%		3.68%	3.263%	3.314%
2024.01.29(월)	203.3	200.4	3.43%	3.484%	3.451%		3.68%	3.304%	3.363%
2024.01.30(화)	196.8		3.55%	3.545%	3.565%		3.68%	3.268%	3.305%

## 한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

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)	2022.07.13(수) 2.25% (▲0.50)
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)	2022.05.26(목) 1.75% (▲0.25)
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)	2022.04.14(목) 1.50% (▲0.25)

## 한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

## ◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2024.01.25(목)	14:00~14:10	7	2024.02.01(목)	35.00	3.50%	0.30	0.9%	2024-005-007

## ◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2024.01.16(화)	14:00~14:10	28	2024.02.13(화)	0.30	1.14	3.48%	0.30	2024-0002-0028
2024.01.23(화)	14:00~14:10	28	2024.02.20(화)	0.20	0.54	3.48%	0.20	2024-0003-0028
2024.01.30(화)	14:00~14:10	28	2024.02.27(화)	0.20	0.31	3.48%	0.20	2024-0004-0028

## 청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
실권주	삼성제약	제약 전문 기업	2024.02.01(목) ~ 2024.02.02(금)	2024.02.06(화)	SK
실권주	알체라	AI 영상 솔루션 및 안면인식 기업	2024.02.01(목) ~ 2024.02.02(금)	2024.02.06(화)	한양

## 관련 정보

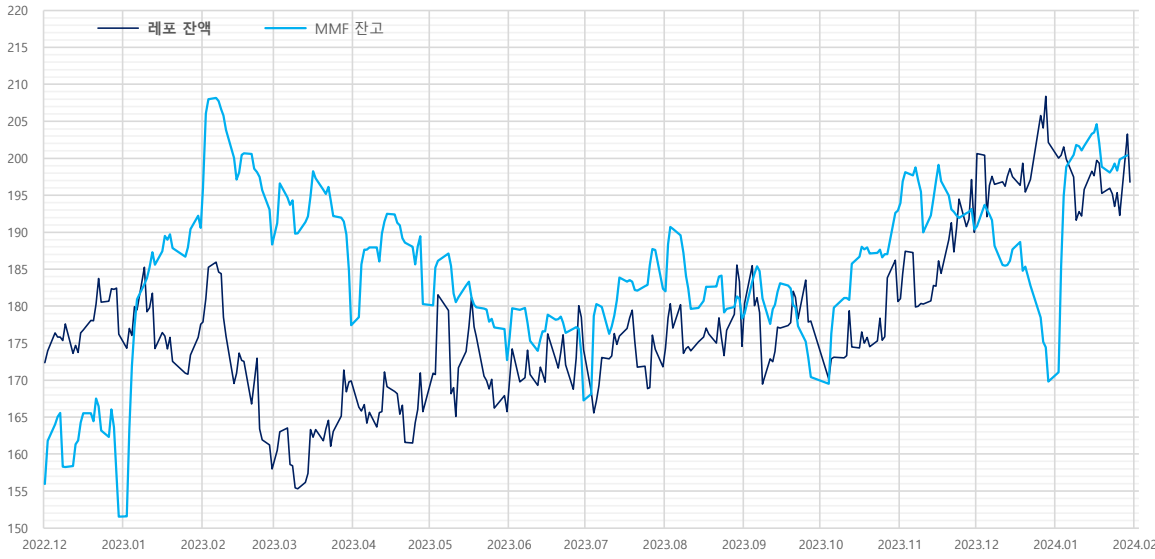
지준일	2024.02.07(수)	금통위	2024.02.22(목)	FOMC	2024.01.30(화) ~ 2024.01.31(수)	한국은행	<a href="http://www.bok.or.kr">http://www.bok.or.kr</a>	
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장   자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	<a href="https://ecos.bok.or.kr">https://ecos.bok.or.kr</a>	
· 한국은행, 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>	무위험지표금리	<a href="https://www.kofr.kr">https://www.kofr.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>	증권정보포털	<a href="https://seibro.or.kr">https://seibro.or.kr</a>
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						<a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttlId=10068266&amp;menuNo=200460">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttlId=10068266&amp;menuNo=200460</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	
2023년 12월	2023.12.01(금)	2023.12.31(일)	01.11(목)	02.07(수)		2023.12.14(목)	2023.12.28(목)	2023.12.12(화) ~ 2023.12.13(수)
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)	07.11(목)	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)	10.10(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

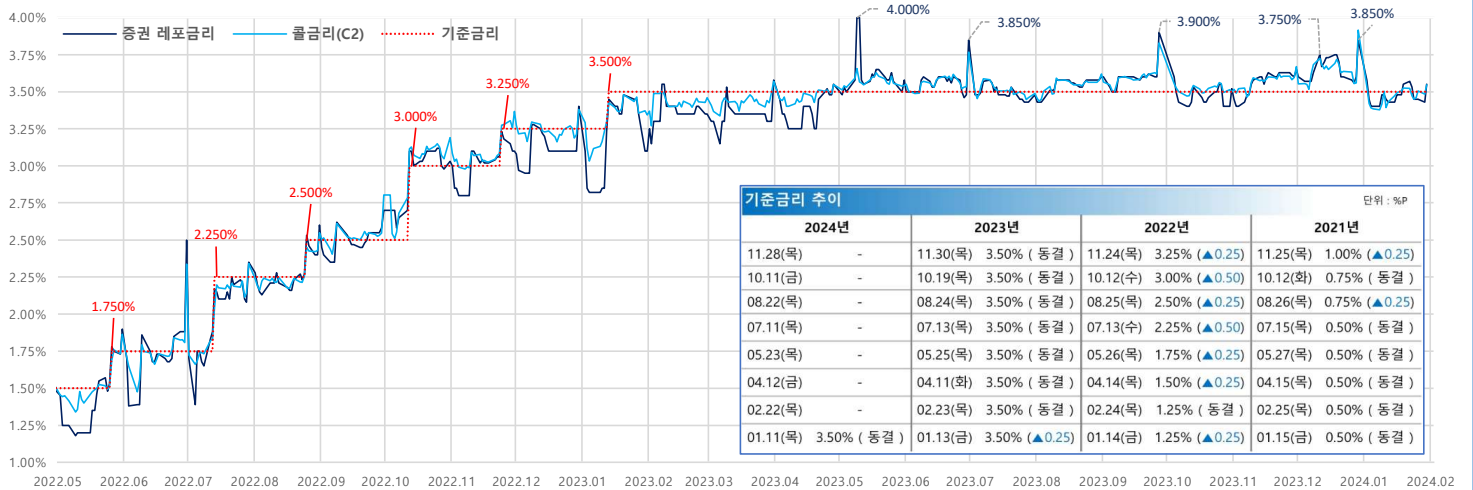
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전월대비	전월대비
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, 예약결제원

단기금융시장 금리 추이

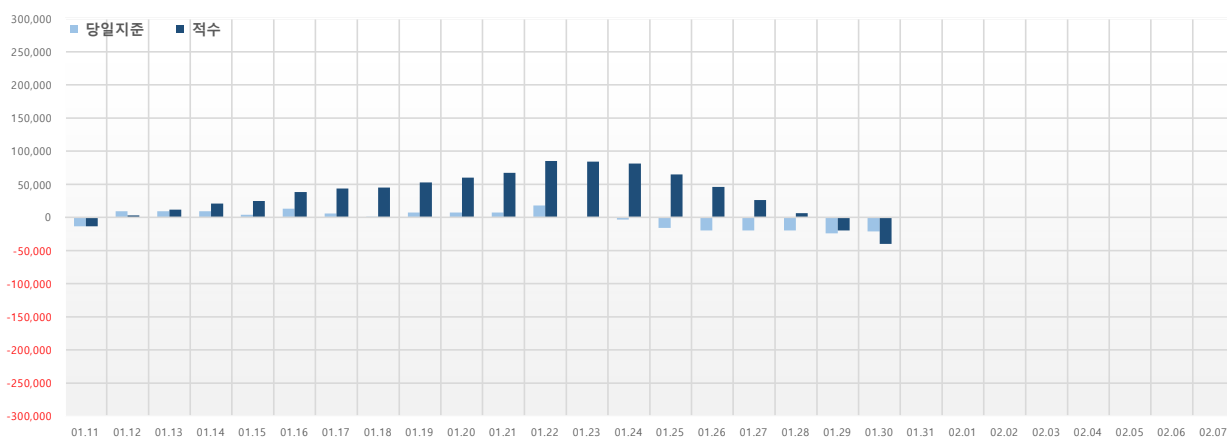


기준금리 추이				단위 : %P			
2024년	2023년	2022년	2021년				
11.28(목)	-	11.30(목)	3.50% (동결)	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(목)	3.50% (동결)	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.22(목)	-	08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.11(목)	-	07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.23(목)	-	05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	1.75% (▲0.25)	05.27(목)	0.50% (동결)
04.12(금)	-	04.11(화)	3.50% (동결)	04.14(목)	1.50% (▲0.25)	04.15(목)	0.50% (동결)
02.22(목)	-	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
01.11(목)	-13,237	-13,237
01.12(금)	9,010	3,028
01.13(토)	9,010	12,038
01.14(일)	9,010	21,048
01.15(월)	3,869	24,919
01.16(화)	13,126	38,042
01.17(수)	5,709	43,599
01.18(목)	1,350	44,947
01.19(금)	7,233	52,616
01.20(토)	7,233	59,849
01.21(일)	7,233	67,082
01.22(월)	18,023	85,107
01.23(화)	-667	84,437
01.24(수)	-3,240	81,200
01.25(목)	-16,060	65,095
01.26(금)	-19,621	45,943
01.27(토)	-19,621	26,322
01.28(일)	-19,621	6,701
01.29(월)	-24,053	-19,261
01.30(화)	-21,531	-39,886
01.31(수)		
02.01(목)		
02.02(금)		
02.03(토)		
02.04(일)		
02.05(월)		
02.06(화)		
02.07(수)		