

레포 시장동향

◎ 전주
국고금 유출입, 청약자금 이동, 부가세 및 월말세입 등 변동요인 많은 한 주였으며, 레포금리 월말까지 가파른 상승세를 보이다 월초 다소 완화되었음.
주 초 부가세에 상응하는 대규모 국고 및 재정자금 집행되어 유동성 개선됐으나 이후 국고여유자금 환수 및 MMF 환매 이어져 시장 부족 전환되었음.
조달금리 부담에도 은행권 매도에 적극적인 모습이었으며, 시장 조달 규모에 비해 월초 유동성 회복 속도 더더 조달여건 크게 개선되지 못했음.

◎ 금일
기준 부족 마감 우려 확대되어 은행권 조달 계속될 전망. 국고 및 공자기금 환수 영향으로 유동성 축소되겠고, 조달금리 상승 예상됨.

기준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.02.02 (금)				2024.02.05 (월)					
공자기금		10,000	재정 [국세환급1.0 실시간1.3]			23,000			
국고여유자금		67,000	자금조정예금 만기			4,000			
금융중개지원대출 신규		17,000							
재정 [국세환급1.0 실시간1.0]		20,000							
자금조정예금 만기		4,000							
국고채 비경쟁인수		-10,000	공자기금 환수			-2,000			
월말세입 본납		-90,000	국고여유자금 환수			-17,000			
화폐 발행		-4,000	국고채 비경쟁인수			-1,000			
자금조정예금		-4,000	세입			-3,000			
기타		-2,000	화폐 발행			-4,000			
			자금조정예금			-4,000			
전일 기준	기준	-2,927	적수	-38,017	금일 예상	기준	-7,000	적수	-51,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.01.29(월)	203.3	200.4	3.43%	3.484%	3.451%	3.500%	3.68%	3.304%	3.363%
2024.01.30(화)	196.8	201.7	3.55%	3.545%	3.565%		3.68%	3.268%	3.305%
2024.01.31(수)	201.8	195.9	3.60%	3.613%	3.613%		3.68%	3.261%	3.294%
2024.02.01(목)	203.4	198.3	3.58%	3.573%	3.593%		3.68%	3.267%	3.293%
2024.02.02(금)	204.8		3.52%	3.541%	3.540%		3.68%	3.248%	3.260%

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

◎ RP매입

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	평균낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2024.01.31(수)	16:00~16:10	8	2024.02.08(목)	4.50	8.40	3.61%	4.50	2023-006-008

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2024.02.01(목)	14:00~14:10	7	2024.02.08(목)	1.85	3.50%	0.30	16.2%	2024-007-007

◎ 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)
공모주	케이웨더	날씨 빅데이터 플랫폼	2024.02.13(화) ~ 2024.02.14(수)	2024.02.16(금)	NH
공모주	이에이트	디지털 트윈 솔루션 기업	2024.02.13(화) ~ 2024.02.14(수)	2024.02.16(금)	한화
공모주	코셉	산업기계 제조 기업	2024.02.13(화) ~ 2024.02.14(수)	2024.02.16(금)	키움
공모주	에이피알	뷰티테크 기업	2024.02.14(수) ~ 2024.02.15(목)	2024.02.19(월)	신한, 하나

관련 정보

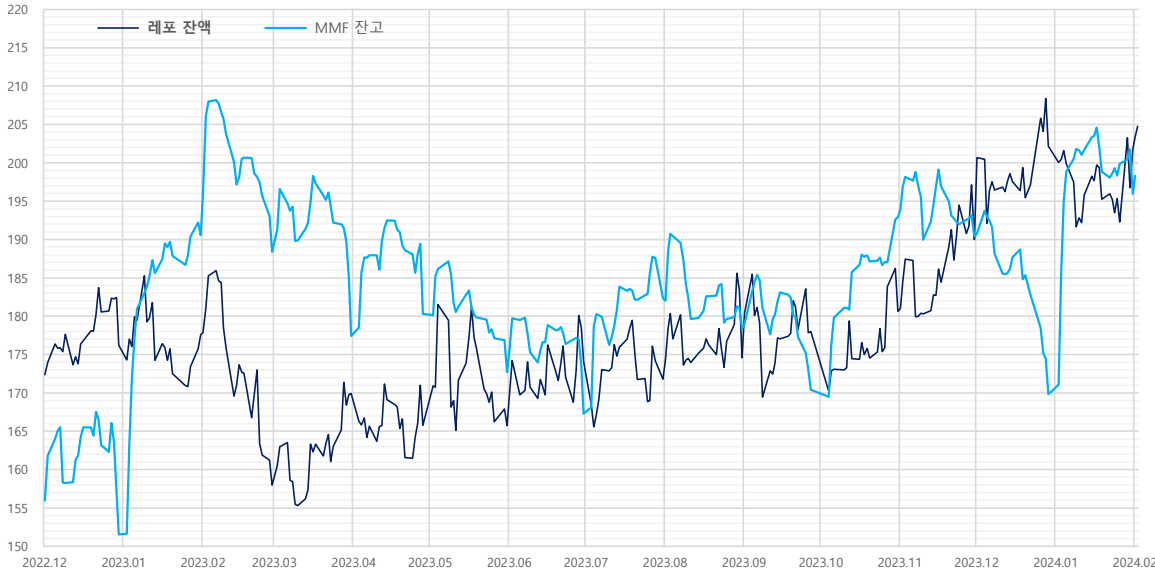
지준일	2024.02.07(수)	금통위	2024.02.22(목)	FOMC	2024.03.19(화) ~ 2024.03.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10082072&menuNo=200690		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(수)	03.31(일)	04.11(목)	05.08(수)	03.14(목)	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

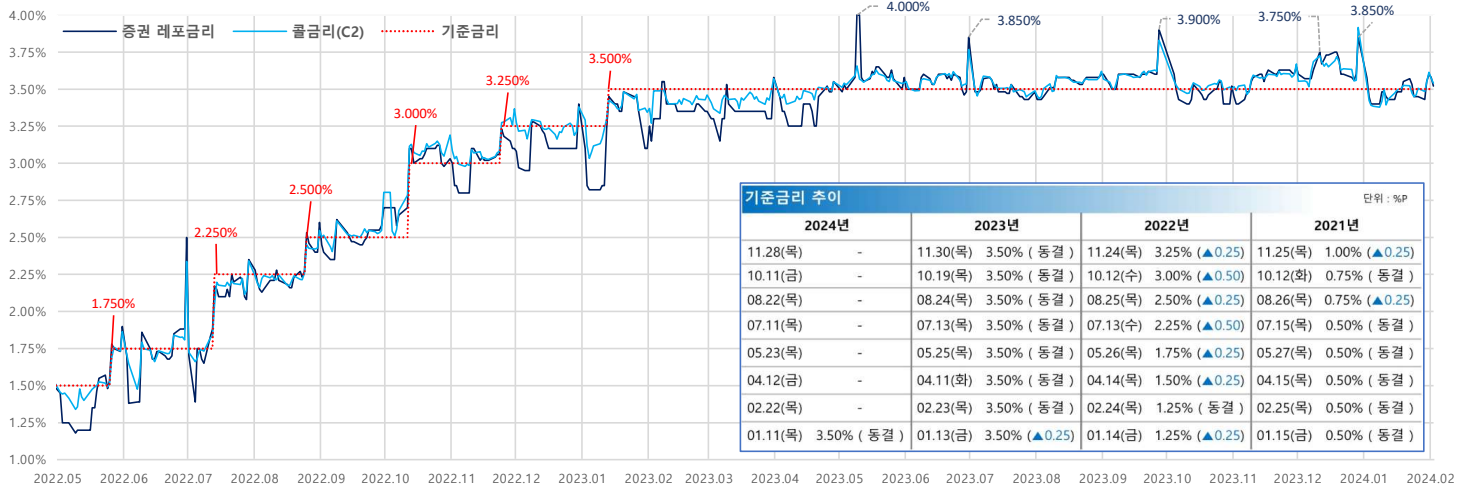
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	전월대비
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

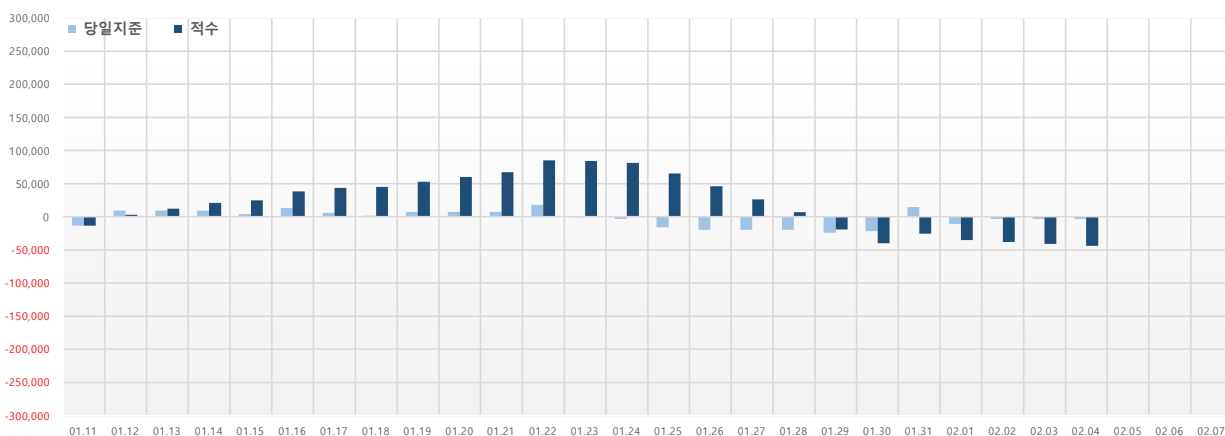


기준금리 추이				단위 : %P
2024년	2023년	2022년	2021년	
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목)	-	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	-	07.13(목) 3.50% (동결)	07.13(수) 2.25% (▲0.50)	07.15(목) 0.50% (동결)
05.23(목)	-	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)	14,453	-25,431
02.01(목)	-11,029	-35,145
02.02(금)	-2,927	-38,017
02.03(토)	-2,927	-40,944
02.04(일)	-2,927	-43,871
02.05(월)		
02.06(화)		
02.07(수)		