

레포 시장동향

◎ 전일

가용 자금 많지 않아 1일물 매도 해소 쉽지 않았으며, 마감일 은행 간 콜-레포 조정 거래 활발했음에도 장 막판까지 조달 정체 지속되었음.

◎ 금일

한은RP매입 만기, 국고 환수, 국고-통안 및 재정증권 발행 등 자금 이탈요인 많아 유동성 대폭 축소되었음. 조달금리 상승 예상되며, 은행권 매수 의존도 증대될 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.02.07 (수)				2024.02.08 (목)					
재정 [국방부0.3 국세환급1.6 실시간0.7]		26,000		한은RP매각 만기(7일)			3,000		
자금조정대출		4,000		공자기금			17,000		
자금조정예금 만기		3,000		재정 [국세환급5.4 실시간1.6]			70,000		
기타		4,000		자금조정예금 만기			3,000		
국고여유자금 환수		-33,000		한은RP매각(7일)			-3,000		
세입		-5,000		한은RP매입 만기(8일)			-45,000		
화폐 발행		-3,000		통안채 발행(2년), 낙찰수익률 3.350%			-20,000		
자금조정대출 만기		-6,000		국고채 발행(2년)			-16,000		
자금조정예금		-3,000		재정증권 발행(63일)			-15,000		
				국고여유자금 환수			-50,000		
				세입			-5,000		
				자금조정대출 만기			-4,000		
				자금조정예금			-3,000		
전일 기준	지준	9,984	적수	704	금일 예상	지준	-58,000	적수	-58,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.02.01(목)	203.4	198.3	3.58%	3.573%	3.593%	3.500%	3.68%	3.267%	3.293%
2024.02.02(금)	204.8	204.5	3.52%	3.541%	3.540%		3.68%	3.248%	3.260%
2024.02.05(월)	207.2	205.8	3.60%	3.573%	3.612%		3.67%	3.312%	3.339%
2024.02.06(화)	201.0	204.9	3.60%	3.572%	3.616%		3.67%	3.292%	3.322%
2024.02.07(수)	202.8		3.60%	3.518%	3.616%		3.67%	3.286%	3.318%

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
2024.02.05(월)	15:30~15:40	8	2024.02.13(화)	2.50	9.00	3.64%	2.50	2023-008-008

◎ 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

◎ 통화안정증권예치금

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	케이워드	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

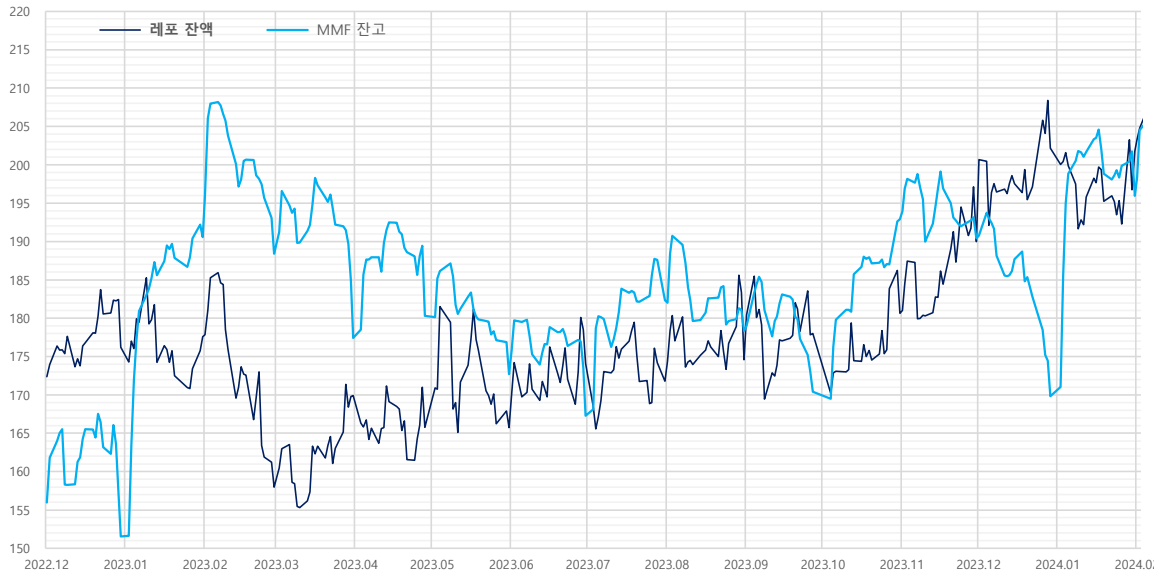
지준일	2024.03.06(수)	금통위	2024.02.22(목)	FOMC	2024.03.19(화) ~ 2024.03.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
금융감독원, RP거래 최소증거금 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10082072&menuNo=200690		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(금)	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

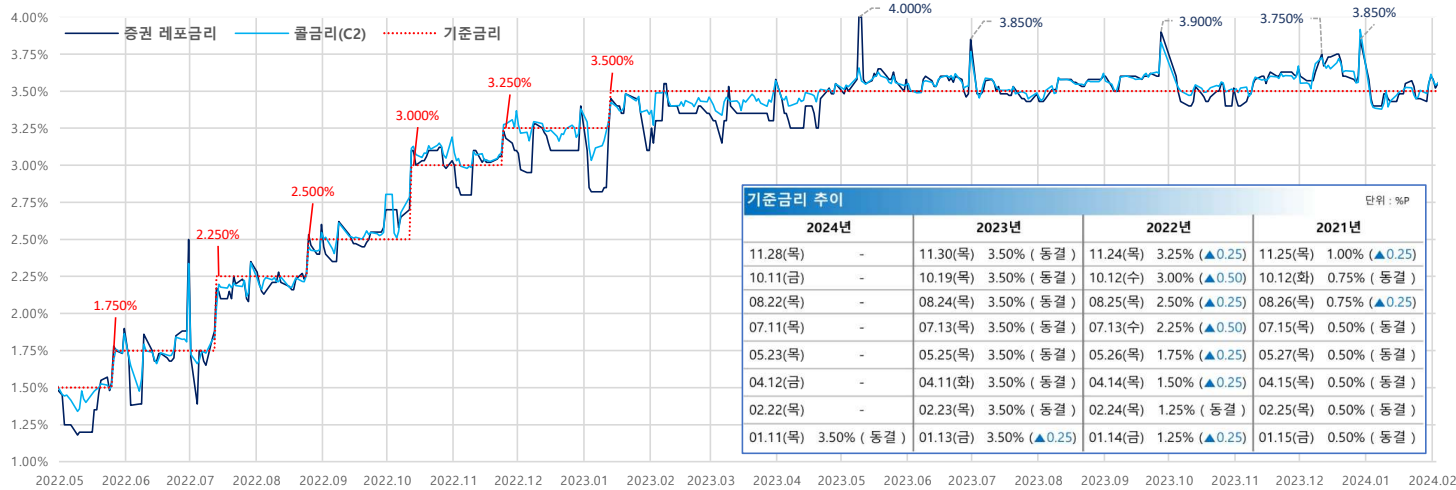
단위 : 조 원



해당월	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

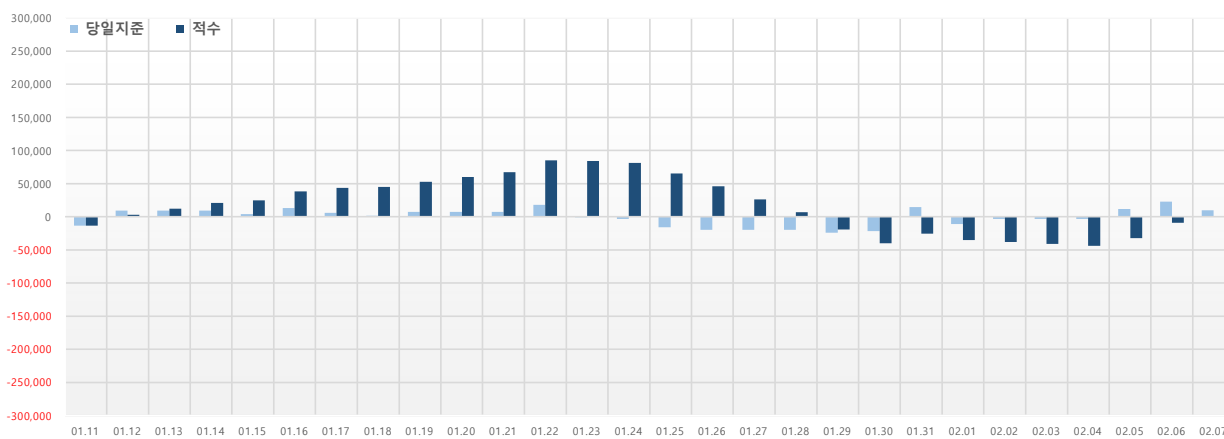


기준금리 추이				단위 : %P
2024년	2023년	2022년	2021년	
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목)	-	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	-	07.13(목) 3.50% (동결)	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)	11,825	-32,051
02.06(화)	23,081	-9,312
02.07(수)	9,984	704