

레포 시장동향

◎ 전주

전전주 지방소비세 예상보다 이르게 집행되어 유동성 개선되리라 기대했으나 주초 일시적인 호전에 그쳐 부족세 매우 강한 한 주였음.
주 중 다수의 스팩 청약자금 운용되어 은행신탁 운용자금 증가했음에도 조달여건 좀처럼 나아지지 못해 은행권 매수 의존도 높았음.
주말 앞두고 국고여유자금 환수 규모 상당하여 담보채권 불문 조달 정체 극심했으며, 한은RP 추가 매입 이후 힘겹게 마감하였음.

◎ 금일

당일기준 및 적수 흐름 크게 호전되어 은행권 조달보다는 운용에 집중할 것으로 예상되며, 조달금리 하락할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.02.23 (금)				2024.02.26 (월)					
한은RP매입(3일)		45,000		공자기금			31,000		
공자기금		6,000		재정 [과가부1.2 국세환급0.2 실시간2.4]			38,000		
재정 [행안부5.5 국세환급0.6 실시간1.5]		76,000		자금조정예금 만기			3,000		
화폐 환수		1,000							
자금조정예금 만기		3,000							
기타		5,000							
국고여유자금 환수		-60,000		한은RP매입 만기(3일)			-45,000		
국고채 비경쟁인수		-8,000		통안채 발행(2년), 시장수익률 3.445%			-7,000		
세입		-4,000		통안채 발행(3년), 시장수익률 3.445%			-1,000		
자금조정예금		-3,000		국고채 비경쟁인수			-11,000		
				국고여유자금 환수			-4,000		
				제기금 환수			-20,000		
				세입			-4,000		
				자금조정예금			-3,000		
전일 기준	지준	77,631	적수	-278,714	금일 예상	지준	55,000	적수	-69,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.02.19(월)	195.0	198.5	3.64%	3.634%	3.707%		3.69%	3.397%	3.437%
2024.02.20(화)	197.0	198.0	3.64%	3.590%	3.671%		3.69%	3.405%	3.452%
2024.02.21(수)	196.6	197.5	3.62%	3.625%	3.651%	3.500%	3.70%	3.402%	3.443%
2024.02.22(목)	195.0	197.1	3.64%	3.659%	3.707%		3.70%	3.342%	3.391%
2024.02.23(금)	192.1		3.69%	3.677%	3.784%		3.70%	3.374%	3.430%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

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)
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)

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매입

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	평균낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2024.02.14(수)	15:00~15:10	13	2024.02.27(화)	7.00	13.60	3.64%	7.00	2023-010-013
2024.02.23(금)	14:00~14:10	3	2024.02.26(월)	4.50	21.55	3.50%	4.50	2023-013-003

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2024.02.22(목)	14:00~14:10	7	2024.02.29(목)	1.94	3.50%	0.20	10.3%	2024-012-007

◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2024.01.30(화)	14:00~14:10	28	2024.02.27(화)	0.20	0.31	3.48%	0.20	2024-0004-0028
2024.02.13(화)	14:00~14:10	28	2024.03.12(화)	0.10	0.22	3.48%	0.10	2024-0005-0028
2024.02.20(화)	14:00~14:10	28	2024.03.19(화)	0.10	0.23	3.48%	0.10	2024-0006-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	하나31호스팩	기업인수목적회사	2024.02.22(목) ~ 2024.02.23(금)	2024.02.27(화)	하나 (1,561억)
실권주	애니젠	펩타이드 바이오소재 개발 기업	2024.02.22(목) ~ 2024.02.23(금)	2024.02.27(화)	신한
공모주	케이엔알시스템	특수목적용시험장비 제조 기업	2024.02.26(월) ~ 2024.02.27(화)	2024.02.29(목)	DB, NH

관련 정보

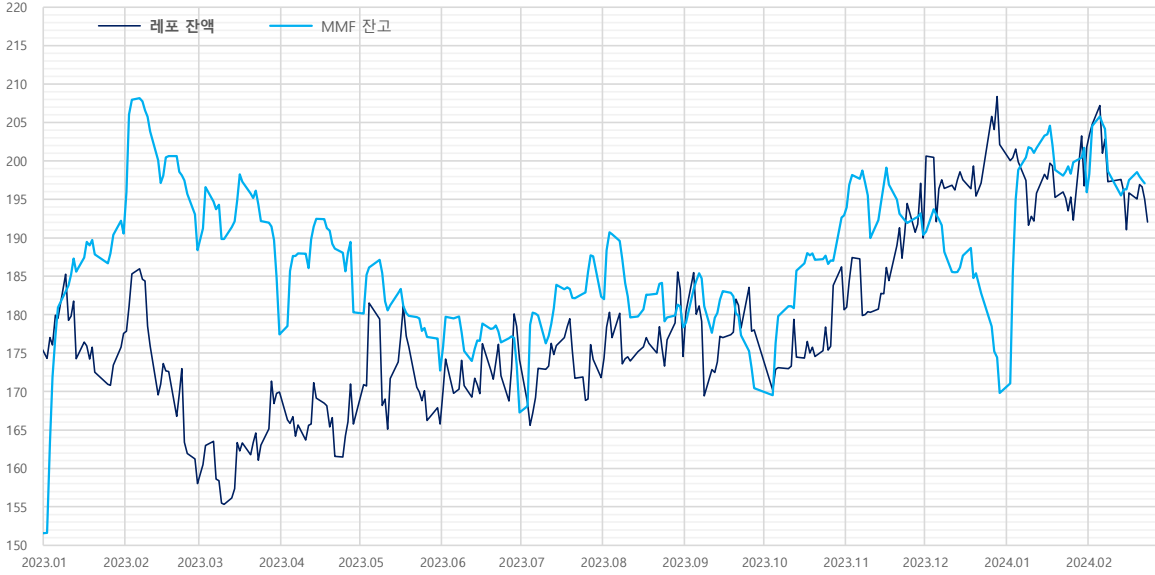
지준일	2024.03.06(수)	금통위	2024.04.12(금)	FOMC	2024.03.19(화) ~ 2024.03.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr	
· 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr	
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlId=10082072&menuNo=200690	무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlId=10078655&menuNo=200690	증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttlId=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)	04.11(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)	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)	11.06(수)	08.22(목)	08.08(목)		
2024년 9월	09.01(일)	09.30(월)	10.10(목)	11.06(수)	11.06(수)	02.08(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

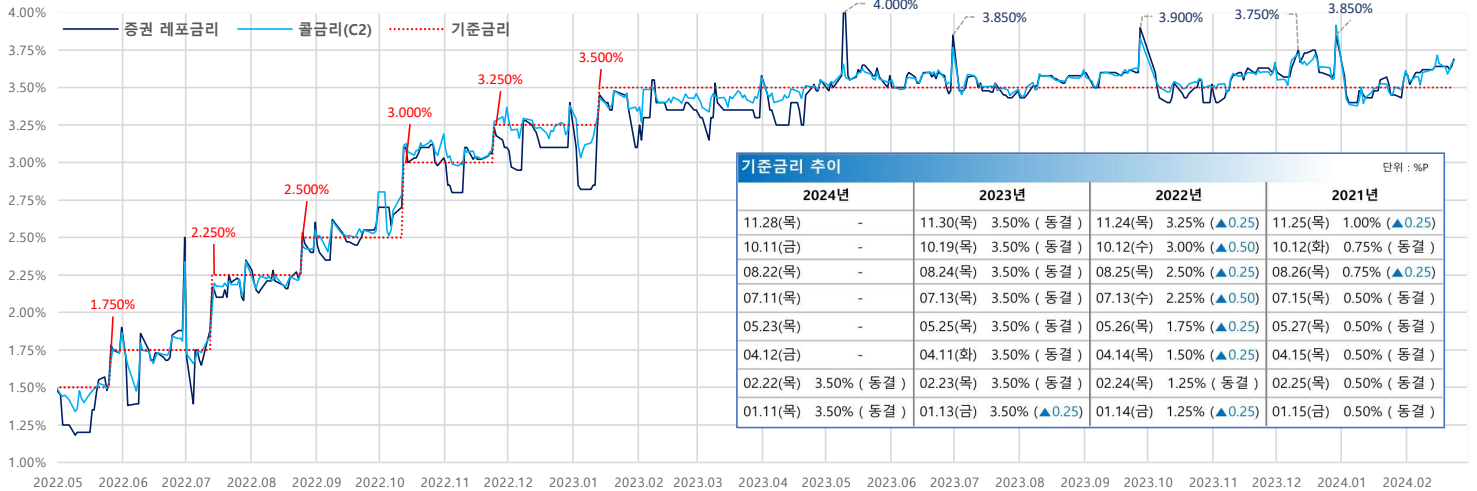
단위 : 조 원



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

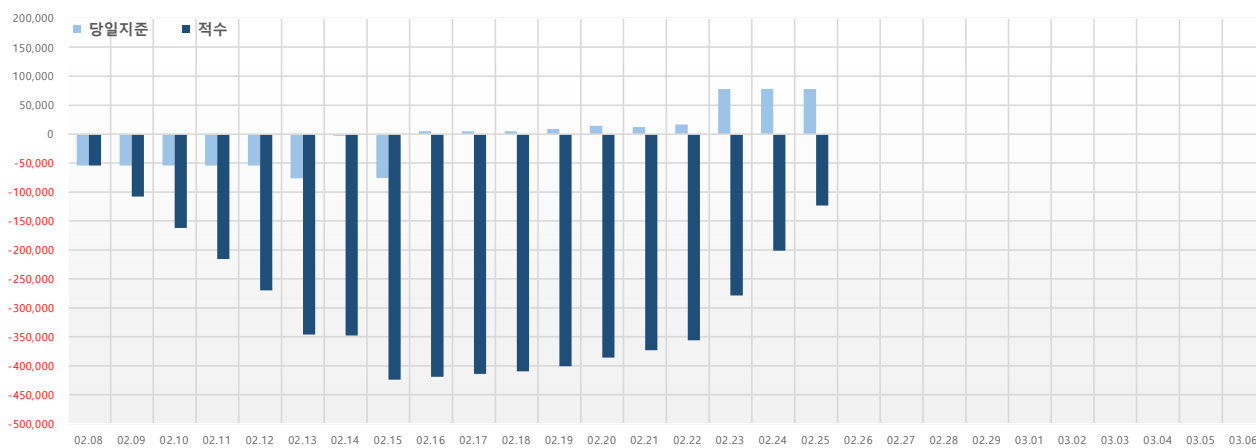


기준금리 추이				단위 : %P
2024년	2023년	2022년	2021년	
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목)	-	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	-	07.13(목) 3.50% (동결)	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)	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
02.08(목)	-53,919	-53,919
02.09(금)	-53,919	-107,838
02.10(토)	-53,919	-161,757
02.11(일)	-53,919	-215,676
02.12(월)	-53,919	-269,595
02.13(화)	-76,334	-345,631
02.14(수)	-2,921	-347,667
02.15(목)	-76,047	-423,702
02.16(금)	4,678	-418,765
02.17(토)	4,678	-414,087
02.18(일)	4,678	-409,409
02.19(월)	8,879	-400,250
02.20(화)	14,391	-385,859
02.21(수)	12,295	-373,067
02.22(목)	16,817	-356,248
02.23(금)	77,631	-278,714
02.24(토)	77,631	-201,083
02.25(일)	77,631	-123,452
02.26(월)		
02.27(화)		
02.28(수)		
02.29(목)		
03.01(금)		
03.02(토)		
03.03(일)		
03.04(월)		
03.05(화)		
03.06(수)		