

레포 시장동향

◎ 전주

시는 풍부한 유동성을 바탕으로 조달보다는 운용에 적극적이었고, 조달여건 크게 개선되어 주 후반부로 갈수록 금리 하락세를 보임. 월말 MMF 환매 및 청약 환불 영향 제한적이었으며, 시은-운용사 잉여세 강해 말일임에도 장 중 잉여 자금 대기하는 모습이었음.

◎ 금일

잉여 마감 가능성 높아 은행권 운용 계속되겠으며, 운용사-신탁 매수 여유있어 익일물 및 기일물 조달금리 낮은 수준 유지될 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.02.29 (목)				2024.03.04 (월)				
한은RP매각 만기(7일)		2,000		통안채 이자			2,000	
재정 등		69,000		재정			15,000	
한은RP매각(7일)		-30,000		금융중개대출 만기			-15,000	
재정증권 발행(63일)		-15,000		월말세입			-15,000	
세입		-18,000						
전일 기준	지준	28,386	적수	금일 예상	지준	15,000	적수	73,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.02.23(금)	192.1	196.8	3.69%	3.677%	3.784%	3.500%	3.70%	3.374%	3.430%
2024.02.26(월)	193.5	196.3	3.65%	3.568%	3.660%		3.70%	3.340%	3.379%
2024.02.27(화)	195.9	198.0	3.55%	3.465%	3.555%		3.70%	3.364%	3.400%
2024.02.28(수)	196.1	200.8	3.40%	3.401%	3.430%		3.70%	3.359%	3.400%
2024.02.29(목)	200.2		3.40%	3.463%	3.437%		3.69%	3.385%	3.432%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2024.02.22(목)	3.50% (동 결)	2023.10.19(목)	3.50% (동 결)	2023.05.25(목)	3.50% (동 결)	2023.01.13(금)	3.50% (▲0.25)	2022.08.25(목)	2.50% (▲0.25)
2024.01.11(목)	3.50% (동 결)	2023.08.24(목)	3.50% (동 결)	2023.04.11(화)	3.50% (동 결)	2022.11.24(목)	3.25% (▲0.25)	2022.07.13(수)	2.25% (▲0.50)
2023.11.30(목)	3.50% (동 결)	2023.07.13(목)	3.50% (동 결)	2023.02.23(목)	3.50% (동 결)	2022.10.12(수)	3.00% (▲0.50)	2022.05.26(목)	1.75% (▲0.25)

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰액	금리	낙찰액	낙찰률	회차번호
2024.02.29(목)	14:00~14:10	7	2024.03.07(목)	30.30	3.50%	3.00	9.9%	2024-014-007

◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정액	응찰금액	낙찰금리	낙찰액	회차번호
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
2024.02.27(화)	14:00~14:10	28	2024.03.26(화)	1.00	3.27	3.48%	1.00	2024-0007-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주관사 / 인수사 (증거금)
공모주	오상헬스케어	체외진단 전문 기업	2024.03.04(월) ~ 2024.03.05(화)	2024.03.07(목)	NH

관련 정보

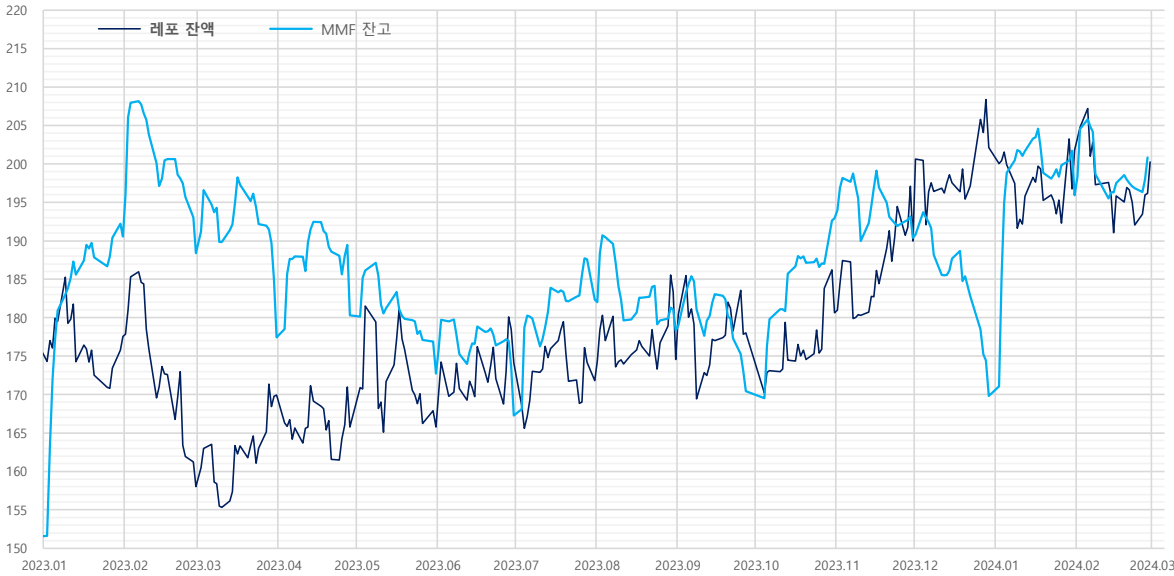
기준일	2024.03.06(수)	금통위	2024.04.12(금)	FOMC	2024.03.19(화) ~ 2024.03.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10082072&menuNo=200690		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(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)		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

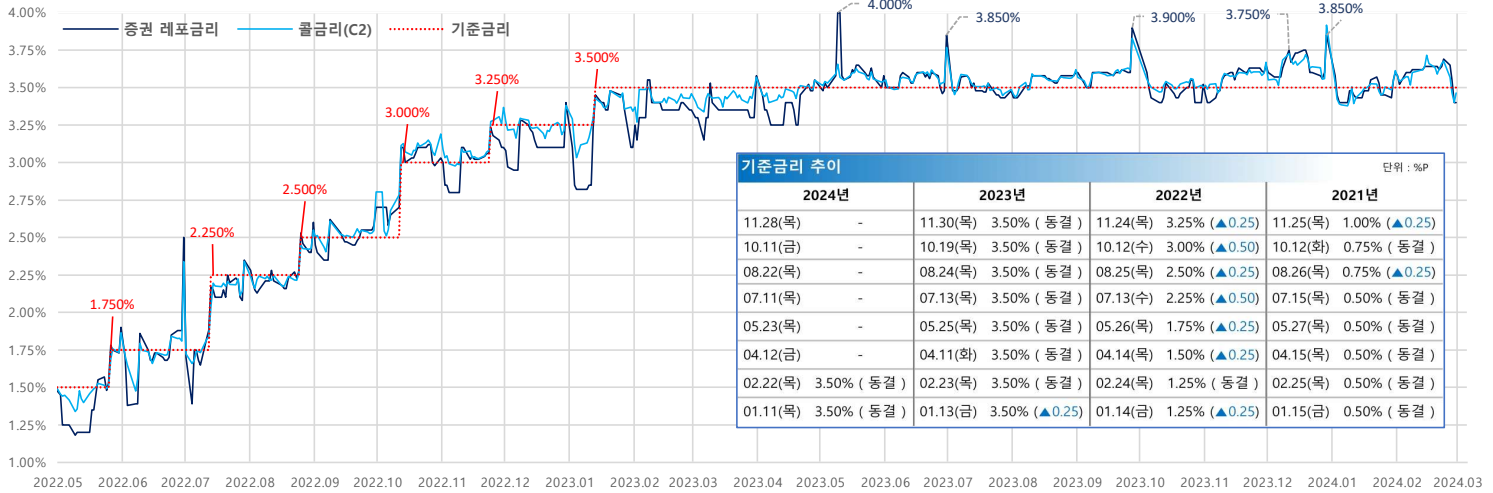
단위 : 조 원



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

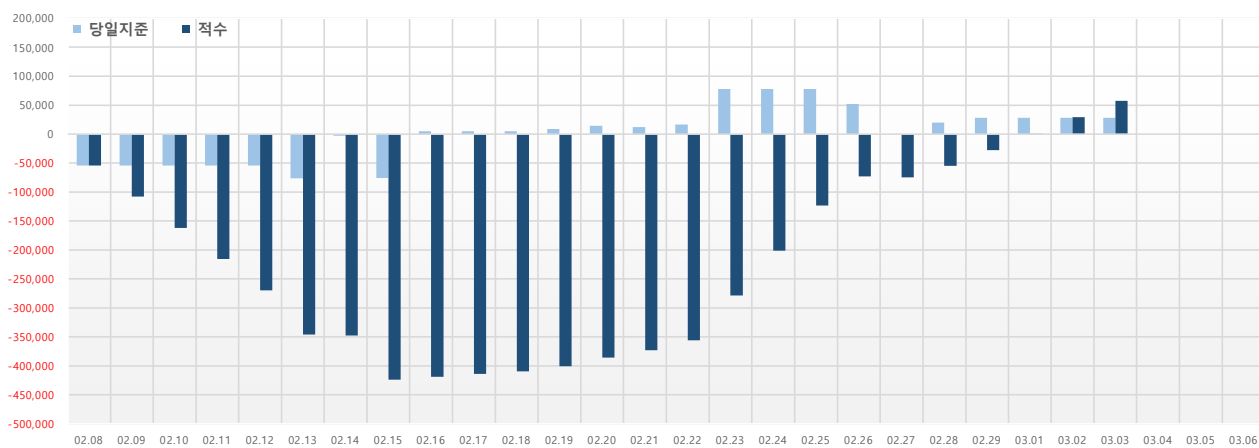


기준금리 추이				단위 : %P
2024년	2023년	2022년	2021년	
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목)	-	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	-	07.13(목) 3.50% (동결)	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	-347,662
02.15(목)	-76,047	-423,707
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)	51,757	-73,097
02.27(화)	-1,329	-74,427
02.28(수)	19,860	-54,674
02.29(목)	28,386	-27,624
03.01(금)	28,386	762
03.02(토)	28,386	29,148
03.03(일)	28,386	57,534
03.04(월)		
03.05(화)		
03.06(수)		