

레포 시장동향

- ◎ 전주
주초 기준 잉여 마감 우려 확대되어 시은 운용에 적극적이었으나 매도처 익일물 및 기일물 조달 희망금리 급락하여 거래 제한적이었음.
한은RP매각으로 유동성 추가 흡수했음에도 매수자금 해소 쉽지 않았으며, 기준일 은행 간 콜 조정 후 소폭 잉여 마감하였음.
주 후반 청약 환불, 국고금 환수 영향으로 시작금리 상승세를 보였으나 시은 및 운용사 매수 꾸준하여 조달여건 매우 양호하였음.

- ◎ 금일
국고채 만기 규모 상당하여 은행권 운용에 적극적이겠으며, 운용사 유동성 풍부해 잉여세 지속되겠음. 시작금리 및 장 중 체결금리 모두 하락할 전망.

기준 증감 요인

단위: 억 원

2024.03.08 (금)				2024.03.11 (월)					
통안채 만기(1년)		20,400	국고채 만기 및 이자			310,000			
재정 및 기타		15,000	재정 및 기타			22,000			
국고금 환수		-250,000	공자기금 환수			-2,000			
세입 및 기타		-10,000	세입 및 기타			-10,000			
전일 기준	기준	-244,241	적수	-262,317	금일 예상	기준	76,000	적수	-675,000

Market Data

단위: 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.03.04(월)	192.0	201.9	3.38%	3.366%	3.420%		3.68%	3.360%	3.403%
2024.03.05(화)	192.4	209.1	3.35%	3.237%	3.417%		3.68%	3.349%	3.387%
2024.03.06(수)	192.1	212.3	3.35%	3.477%	3.419%	3.500%	3.68%	3.325%	3.362%
2024.03.07(목)	199.6	212.5	3.40%	3.375%	3.422%		3.68%	3.321%	3.364%
2024.03.08(금)	198.6		3.58%	3.546%	3.591%		3.68%	3.271%	3.306%

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

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰액	금리	낙찰액	낙찰률	회차번호
2024.03.07(목)	14:00~14:10	7	2024.03.14(목)	22.70	3.50%	3.00	13.2%	2024-016-007

◎ 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 정보

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주관사 / 인수사 (증거금)
실권주	엘지디스플레이	디스플레이 패널 제조 기업	2024.03.11(월) ~ 2024.03.12(화)	2024.03.14(목)	한투, NH, KB, 대신
공모주	삼현	자동차 부품 전문 기업	2024.03.12(화) ~ 2024.03.13(수)	2024.03.15(금)	한투
공모주	엔젤로보틱스	웨어러블 로봇 전문 기업	2024.03.14(목) ~ 2024.03.15(금)	2024.03.19(화)	NH
실권주	대한전선	전선 제조 기업	2024.03.14(목) ~ 2024.03.15(금)	2024.03.19(화)	KB, 미래, NH

관련 정보

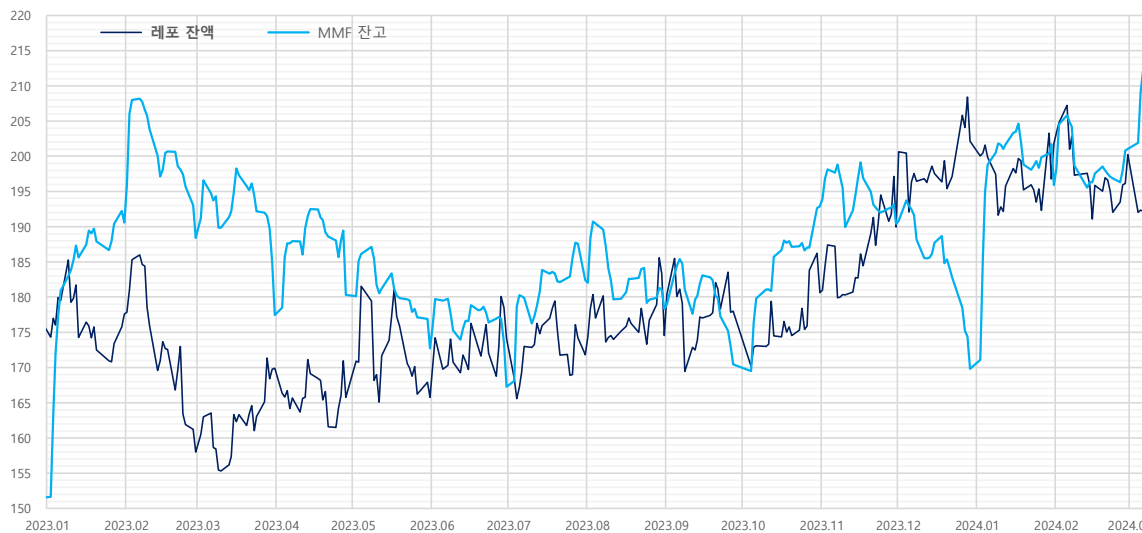
지준일	2024.04.10(수)	금통위	2024.04.12(금)	FOMC	2024.03.19(화) ~ 2024.03.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10082072&mnuNo=200690		무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10078655&mnuNo=200690		증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttid=10068266&mnuNo=200460		금융투자협회	https://kofiabond.or.kr

기준 계산·적립기간, 금통위 및 FOMC

	기준 계산기간		기준 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

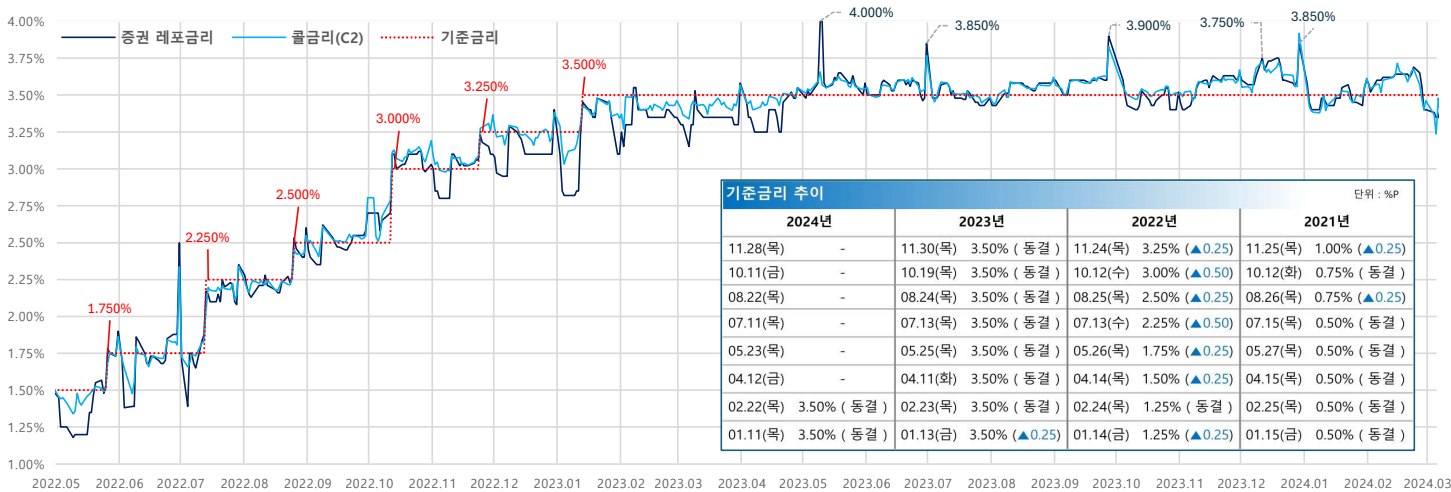
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전월대비	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

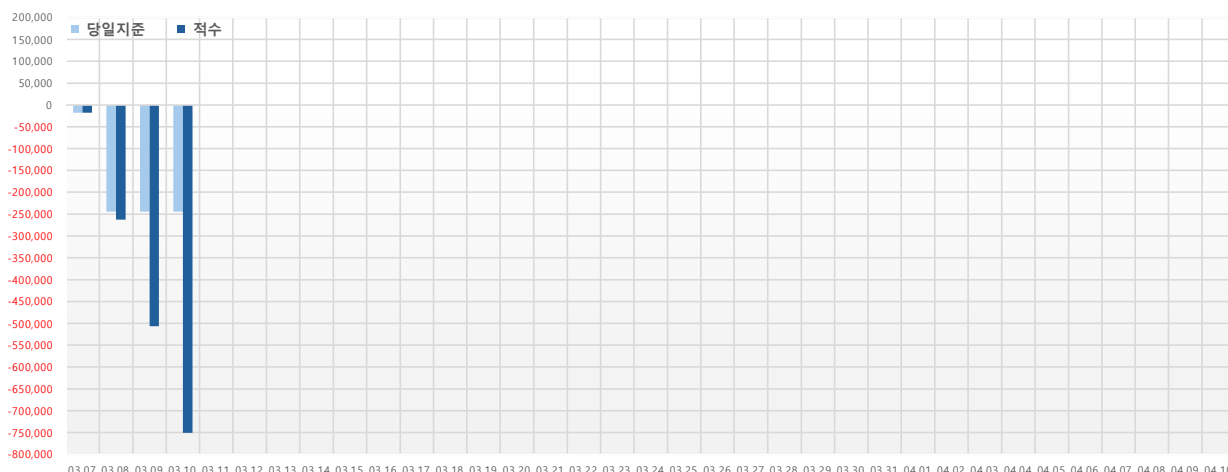


기준금리 추이				단위 : %P
2024년	2023년	2022년	2021년	
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(금) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목)	-	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	-	07.13(목) 3.50% (동결)	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

당일기준 및 적수 추이

단위 : 억 원



	당일기준	적수
03.07(목)	-18,036	-18,036
03.08(금)	-244,241	-262,317
03.09(토)	-244,241	-506,558
03.10(일)	-244,241	-750,799
03.11(월)		
03.12(화)		
03.13(수)		
03.14(목)		
03.15(금)		
03.16(토)		
03.17(일)		
03.18(월)		
03.19(화)		
03.20(수)		
03.21(목)		
03.22(금)		
03.23(토)		
03.24(일)		
03.25(월)		
03.26(화)		
03.27(수)		
03.28(목)		
03.29(금)		
03.30(토)		
03.31(일)		
04.01(월)		
04.02(화)		
04.03(수)		
04.04(목)		
04.05(금)		
04.06(토)		
04.07(일)		
04.08(월)		
04.09(화)		
04.10(수)		