

레포 시장동향

◎ 전일

청약자금 유입되어 금리 하락했으나 시은 매도 증가하여 자금 해소 원활하였음. 분기말 앞두고 있음에도 잉여세 강해 기일물 금리 기준금리를 소폭 상회함.

◎ 금일

청약 환율 영향으로 유동성 축소되었으나 환매대기자금 등 매수 충분하여 잉여세 지속되었음. 금리 수준에 따라 은행권 양방향 움직임 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위: 억 원

2024.03.27 (수)				2024.03.28 (목)					
재정 및 기타		35,000		한은RP매각 만기(7일)			90,000		
				재정 및 기타			45,000		
국고채 발행(20년)		-8,000		한은RP매각(7일)			-110,000		
세입 및 기타		-25,000		통안채 발행(1년), 시장수익률 3.410%			-1,000		
				통안채 발행(2년), 시장수익률 3.370%			-5,000		
				통안채 발행(3년), 시장수익률 3.370%			-4,000		
				재정증권 발행(63일)			-20,000		
				세입 및 기타			-10,000		
전일 기준	지준	74,930	적수	140,020	금일 예상	지준	60,000	적수	200,000

Market Data

단위: 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.03.21(목)	194.8	201.1	3.55%	3.529%	3.569%		3.65%	3.306%	3.349%
2024.03.22(금)	193.4	200.5	3.48%	3.476%	3.491%		3.65%	3.284%	3.317%
2024.03.25(월)	194.6	198.8	3.40%	3.482%	3.409%	3.500%	3.65%	3.290%	3.331%
2024.03.26(화)	198.8	198.4	3.30%	3.471%	3.341%		3.64%	3.301%	3.340%
2024.03.27(수)	202.7		3.28%	3.440%	3.308%		3.63%	3.288%	3.322%

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
2024.03.21(목)	14:00~14:10	7	2024.03.28(목)	26.53	3.50%	9.00	33.9%	2024-018-007

◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정액	응찰금액	낙찰금리	낙찰액	회차번호
2024.03.12(화)	14:00~14:10	28	2024.04.09(화)	1.00	3.84	3.45%	1.00	2024-0008-0028
2024.03.19(화)	14:00~14:10	28	2024.04.16(화)	1.50	1.84	3.52%	1.54	2024-0010-0028
2024.03.26(화)	14:00~14:10	28	2024.04.23(화)	2.00	3.61	3.48%	2.40	2024-0011-0028
	14:30~14:40	7	2024.04.02(화)	3.00	4.15	3.46%	3.60	2024-0012-0007

청약 정보

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주공사 / 인수사 (증거금)
공모주	아이엠비디엑스	암 조기진단 기업	2024.03.25(월) ~ 2024.03.26(화)	2024.03.28(목)	미래 (10.78조)
공모주	신한제12호스팩	기업인수목적회사	2024.04.02(화) ~ 2024.04.03(수)	2024.04.05(금)	신한

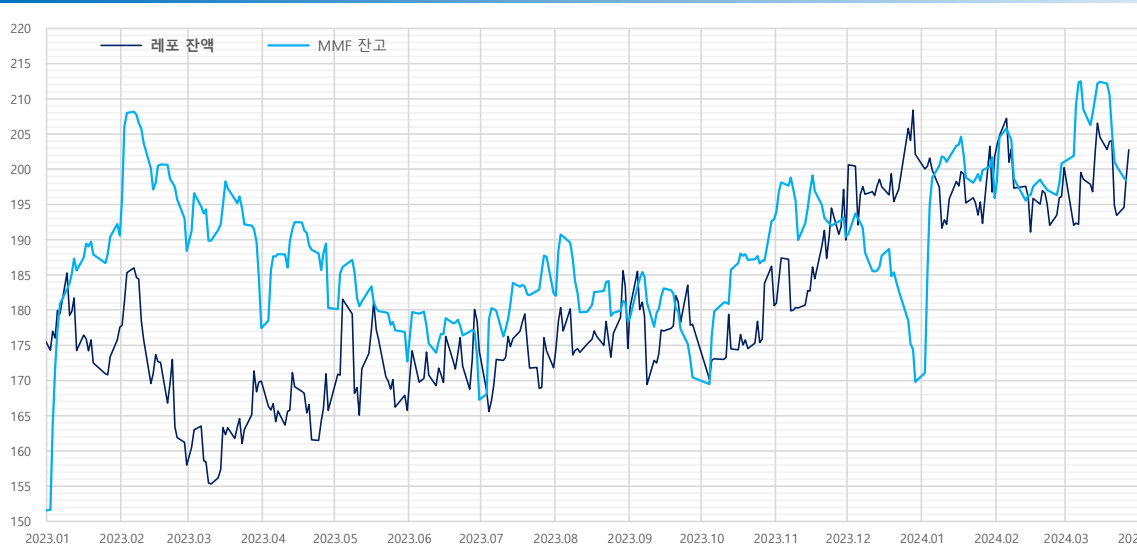
관련 정보

지준일	2024.04.10(수)	금통위	2024.04.12(금)	FOMC	2024.04.30(화) ~ 2024.05.01(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?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

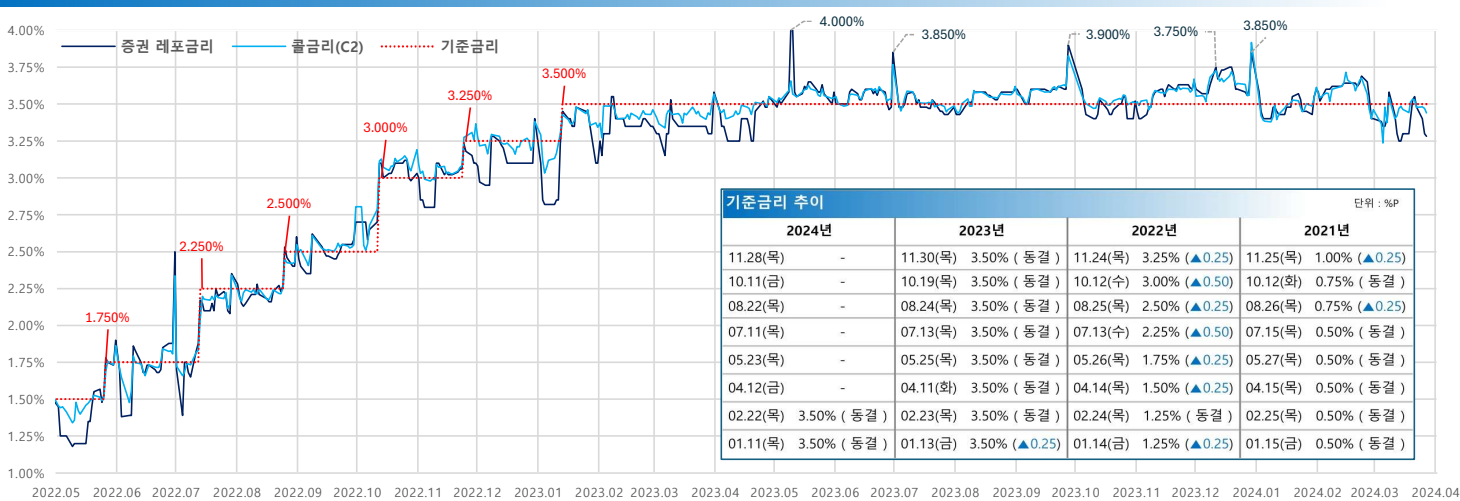


단위 : 조 원

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



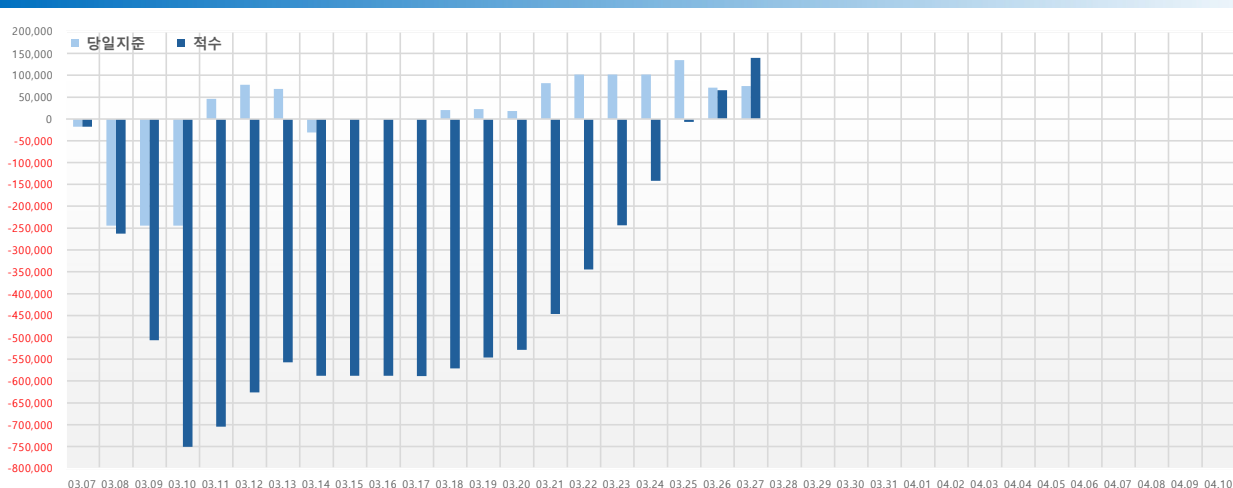
기준금리 추이

2024년				2023년				2022년				2021년			
연월	금리	동결	변동	연월	금리	동결	변동	연월	금리	동결	변동	연월	금리	동결	변동
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)		08.26(목)	0.75%	(▲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)	

단위 : %P

자료 : 한국은행

당일지준 및 적수 추이



단위 : 억 원

연월	당일지준	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)	46,026	-704,777
03.12(화)	78,327	-626,452
03.13(수)	68,714	-557,736
03.14(목)	-30,591	-587,830
03.15(금)	-412	-587,744
03.16(토)	-412	-588,156
03.17(일)	-412	-588,568
03.18(월)	19,994	-571,124
03.19(화)	22,588	-546,014
03.20(수)	17,635	-528,658
03.21(목)	82,257	-446,370
03.22(금)	101,496	-344,673
03.23(토)	101,496	-243,177
03.24(일)	101,496	-141,681
03.25(월)	134,479	-6,801
03.26(화)	71,850	65,088
03.27(수)	74,930	140,020
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)		