

레포 시장동향

◎ 전일

청약 환불 영향으로 시작금리 상승했으며, 시은 매도 증가하여 잉여 자금 쉽사리 해소되었음. 장 중 추가 자금 많지 않아 오후께 매도 정체되었음.

◎ 금일

운용사 및 신탁 매수 감소 예상되나 전일 한은RP매각 감액으로 은행권 유동성 개선되어 분기말임에도 조달여건 양호할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2024.03.28 (목) | | | | 2024.03.29 (금) | | | | | |
|--------------------------|-----------|----------------|-----------|----------------|--------------|-----------|----------------|-----------|----------------|
| 한은RP매각 만기(7일) | | 90,000 | 재정 및 기타 | | | 49,000 | | | |
| 재정 및 기타 | | 51,000 | | | | | | | |
| 한은RP매각(7일) | | -60,000 | 세입 및 기타 | | | -12,000 | | | |
| 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 | | -15,000 | | | | | | | |
| 전일 기준 | 지준 | 111,238 | 적수 | 251,254 | 금일 예상 | 지준 | 148,000 | 적수 | 399,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2024.03.22(금) | 193.4 | 200.5 | 3.48% | 3.476% | 3.491% | 3.500% | 3.65% | 3.284% | 3.317% |
| 2024.03.25(월) | 194.6 | 198.8 | 3.40% | 3.482% | 3.409% | | 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 | 200.3 | 3.28% | 3.440% | 3.308% | | 3.63% | 3.288% | 3.322% |
| 2024.03.28(목) | 200.3 | | 3.40% | 3.502% | 3.435% | | 3.64% | 3.293% | 3.324% |

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 |
|---------------|-------------|----|---------------|-------|-------|------|-------|--------------|
| 2024.03.28(목) | 14:00~14:10 | 7 | 2024.04.04(목) | 23.74 | 3.50% | 6.00 | 25.3% | 2024-019-007 |

◎ 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 | 주간사 / 인수사 (증거금) |
|-----|----------|----------|-------------------------------|---------------|-----------------|
| 공모주 | 신한제12호스팩 | 기업인수목적회사 | 2024.04.02(화) ~ 2024.04.03(수) | 2024.04.05(금) | 신한 |
| 공모주 | 신한제13호스팩 | 기업인수목적회사 | 2024.04.11(목) ~ 2024.04.12(금) | 2024.04.15(월) | 신한 |

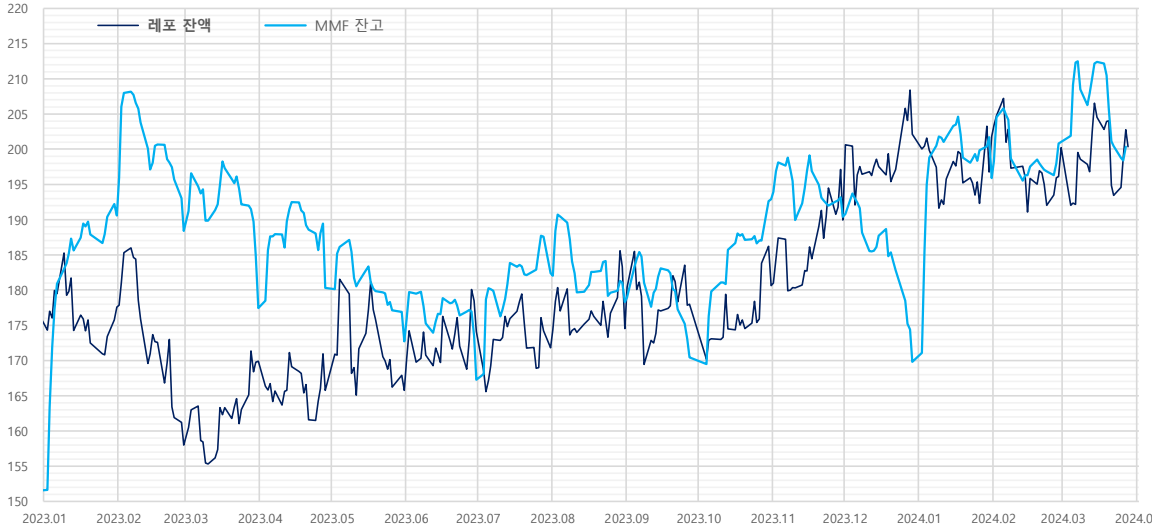
관련 정보

| 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) | 한은RP매각 만기 | 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

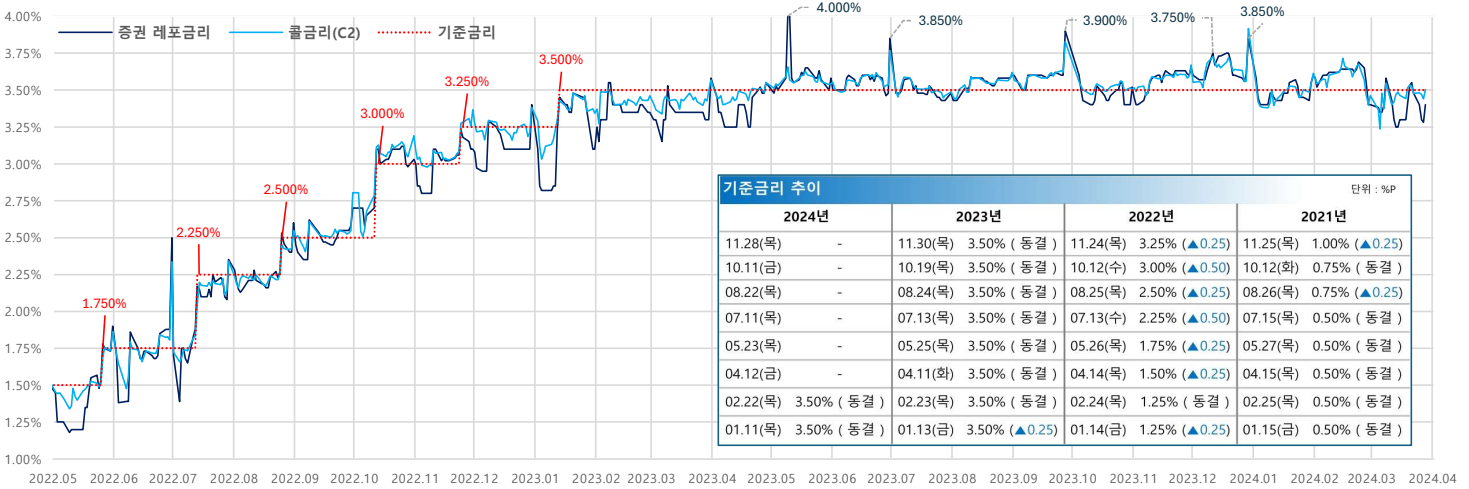


단위 : 조 원

| 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

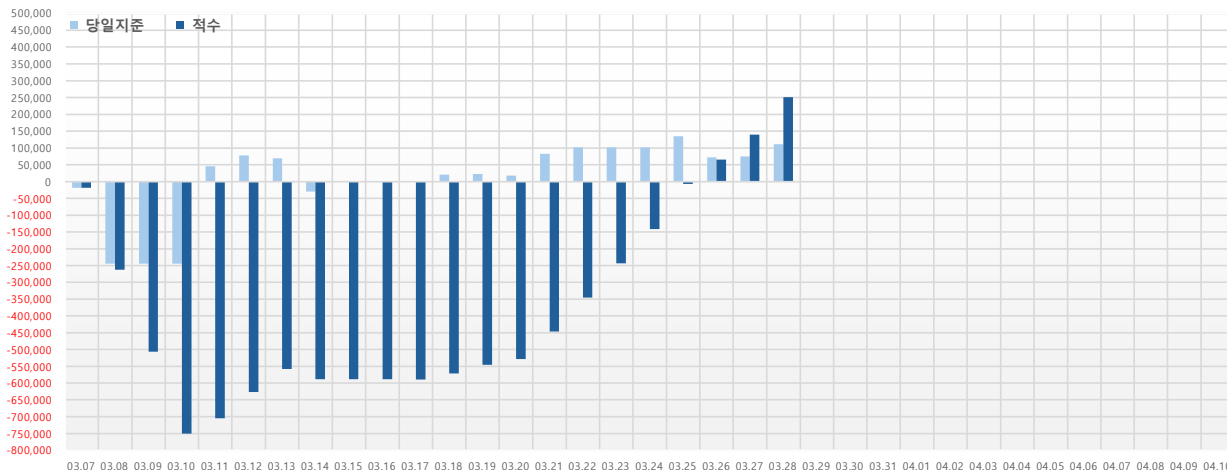


단위 : %P

| 기준금리 추이 | | | |
|----------|------------|------------------------|------------------------|
| 2024년 | 2023년 | 2022년 | 2021년 |
| 11.28(목) | - | 11.30(목) 3.50% (동결) | 11.24(목) 3.25% (▲0.25) |
| 10.11(금) | - | 10.19(금) 3.50% (동결) | 10.12(수) 3.00% (▲0.50) |
| 08.22(목) | - | 08.24(목) 3.50% (동결) | 08.26(목) 0.75% (▲0.25) |
| 07.11(목) | - | 07.13(목) 3.50% (동결) | 07.13(수) 2.25% (▲0.50) |
| 05.23(목) | - | 05.25(목) 3.50% (동결) | 05.26(목) 1.75% (▲0.25) |
| 04.12(금) | - | 04.11(화) 3.50% (동결) | 04.14(목) 1.50% (▲0.25) |
| 02.22(목) | 3.50% (동결) | 02.23(목) 3.50% (동결) | 02.24(목) 1.25% (동결) |
| 01.11(목) | 3.50% (동결) | 01.13(금) 3.50% (▲0.25) | 01.14(금) 1.25% (▲0.25) |
| | | 01.14(금) | 01.15(금) 0.50% (동결) |

자료 : 한국은행

당일지준 및 적수 추이



단위 : 억 원

| | 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) | 111,238 | 251,254 |
| 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) | | |