

레포 시장동향

◎ 지난주

주초 국고금 환수 및 원천세 납부 영향으로 금리 상승한 가운데 한국은행 RP매입을 통해 선제적으로 유동성 공급했음에도 수급 타이트한 모습을 보임. 적수 부족폭 확대됨에 따라 상당수 은행 운용 보다는 조달에 집중하는 모습이었으며, 주 후반부로 갈수록 매도 희망금리 하락했으나 수요는 유지되었음. 주 중반 이후 청약 및 건보자금 유입과 더불어 지방소비세 방출되어 분위가 개선되었고, 조달금리 소폭 하락한 3.53% 수준 유지되었음.

◎ 금일

국고금 유출입 혼재한 가운데 한은RP매입 만기 도래하여 유동성 축소되었음. 은행권 양방향 움직임 가변적이겠고, 시은 매도 규모가 수급 변수로 작용할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.05.17 (금)				2024.05.20 (월)				
통안채 중도환매		20,000		공자기금			12,000	
공자기금		5,000		재정 및 기타			20,000	
국고여유자금		27,000						
재정 및 기타 [지방소비세]		58,000						
통안채 발행(3년), 낙찰수익률 3.400%			-12,000	한은RP매입 만기(7일)			-60,000	
세입 및 기타			-27,000	국고여유자금 환수			-14,000	
				세입 및 기타			-20,000	
전일 기준	지준	36,254	적수	금일 예상	지준	-26,000	적수	-280,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.05.10(금)	186.6	206.1	3.53%	3.546%	3.553%	3.500%	3.58%	3.440%	3.478%
2024.05.13(월)	188.1	204.9	3.57%	3.574%	3.590%		3.59%	3.452%	3.493%
2024.05.14(화)	190.0	205.2	3.57%	3.563%	3.587%		3.60%	3.454%	3.489%
2024.05.16(목)	194.1	206.5	3.53%	3.542%	3.546%		3.60%	3.375%	3.408%
2024.05.17(금)	195.6		3.53%	3.534%	3.548%		3.60%	3.379%	3.413%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2024.04.12(금)	3.50% (동 결)	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)
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)

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매입

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰액	금리	낙찰액	낙찰률	회차번호
2024.05.13(월)	14:00~14:10	7	2024.05.20(월)	7.05	3.52%	6.00	85.1%	2024-026-007

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰액	금리	낙찰액	낙찰률	회차번호
2024.05.16(목)	14:00~14:10	7	2024.05.23(목)	2.20	3.50%	0.20	9.1%	2024-027-007

◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정액	응찰금액	낙찰금리	낙찰액	회차번호
2024.04.23(화)	14:00~14:10	28	2024.05.21(화)	0.70	1.50	3.50%	0.70	2024-0017-0028
2024.04.30(화)	14:00~14:10	28	2024.05.28(화)	0.10	0.24	3.48%	0.10	2024-0018-0028
2024.05.14(화)	14:00~14:10	28	2024.06.11(화)	0.10	0.20	3.48%	0.10	2024-0019-0028

청약 정보

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	미래에셋비전스팩4호	기업인수목적회사	2024.05.20(월) ~ 2024.05.21(화)	2024.05.23(목)	미래

관련 정보

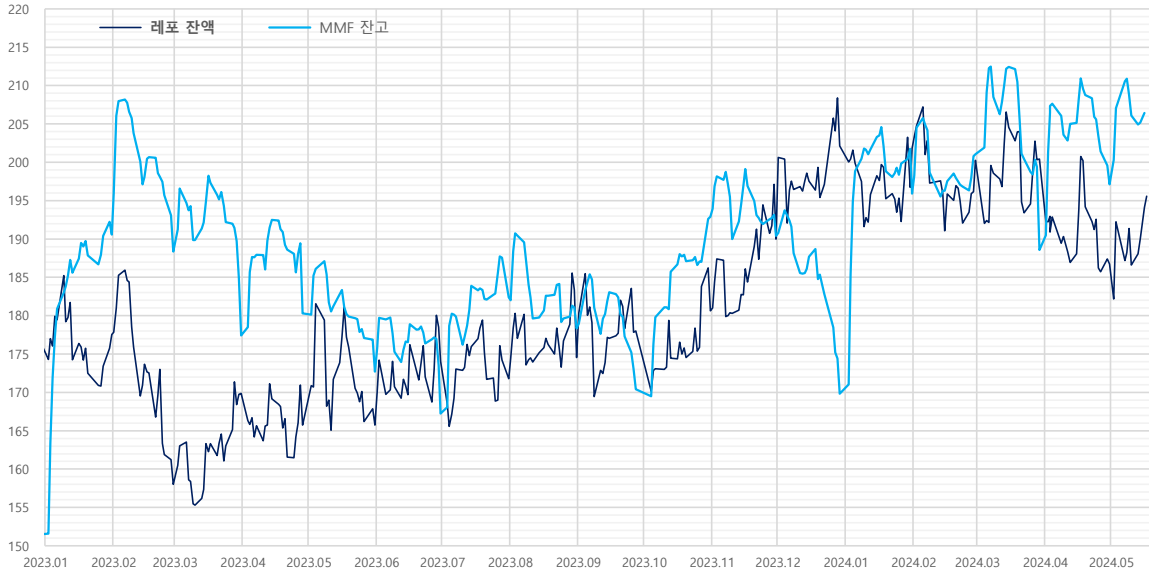
지준일	2024.06.05(수)	금통위	2024.05.23(목)	FOMC	2024.06.11(화) ~ 2024.06.12(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr	
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr	
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttId=10082072&menuNo=200690	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

◎ 전일	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



월말 MMF 증감내역			
해당연월	MMF	전일대비	전월대비
2024.03.29	188.6	-10.9	-12.4
2024.02.29	201.0	0.2	5.1
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, 메탁결제원

단기금융시장 금리 추이

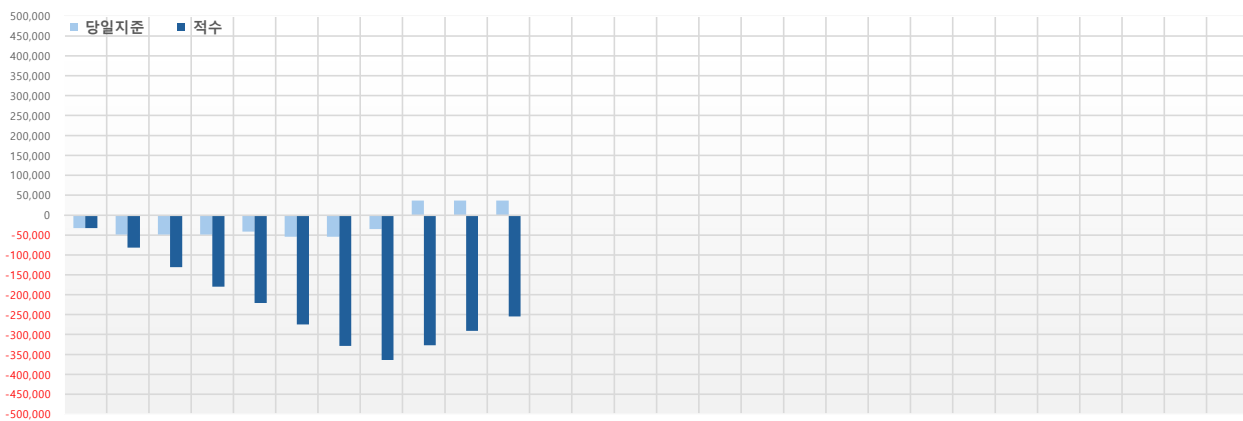


기준금리 추이							
2024년		2023년		2022년		2021년	
11.28(목)	-	11.30(목)	3.50% (동결)	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(금)	3.50% (동결)	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.22(목)	-	08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.11(목)	-	07.13(목)	3.50% (동결)	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)	3.50% (동결)	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
05.09(목)	-32,903	-32,903
05.10(금)	-48,862	-81,765
05.11(토)	-48,862	-130,627
05.12(일)	-48,862	-179,489
05.13(월)	-41,393	-220,903
05.14(화)	-54,181	-274,633
05.15(수)	-54,181	-328,814
05.16(목)	-35,066	-363,425
05.17(금)	36,254	-327,174
05.18(토)	36,254	-290,920
05.19(일)	36,254	-254,666
05.20(월)		
05.21(화)		
05.22(수)		
05.23(목)		
05.24(금)		
05.25(토)		
05.26(일)		
05.27(월)		
05.28(화)		
05.29(수)		
05.30(목)		
05.31(금)		
06.01(토)		
06.02(일)		
06.03(월)		
06.04(화)		
06.05(수)		