

레포 시장동향

◎ 전일

시는 조달 규모 급감했으나 기준일 앞두고 2일물 자금 많지 않아 매도 쉽지 않았음. 환불 일정 제약으로 청약자금 운용되지 못해 시장 타이트한 모습을 보임.

◎ 금일

공모주 청약(LS머트리얼즈) 환불에 따른 1일물 매도 수요 클 것으로 예상되며, 빠듯한 장세 이어지겠음. 기준일 은행 간 콜 조정 후 소폭 잉여 마감할 전망.

기준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.12.05 (화)				2023.12.06 (수)					
한은RP매입(6일)		25,000		재정 [국방부1.0 국세환급0.6 실시간0.4]			20,000		
통안채 만기 및 이자(91일)		12,300		자금조정예금 만기			7,000		
공자기금		16,000		기타			10,000		
재정 [국세환급0.7 실시간0.5]		12,000							
자금조정예금 만기		5,000							
기타		3,000							
통안채 발행(91일), 낙찰수익률 3.550% 낙찰할인율 : 3.519%		-7,000		공자기금 환수			-1,000		
국고채 발행(3년)		-7,000		국고여유자금 환수			-14,000		
국고여유자금 환수		-5,000		세입			-6,000		
제기금 환수		-9,000		자금조정예금			-5,000		
세입		-4,000							
자금조정예금		-7,000							
전일 기준	기준	52,386	적수	-52,676	금일 예상	기준	63,000	적수	11,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.11.29(수)	197.1	193.2	3.60%	3.595%	3.611%	3.500%	3.84%	3.554%	3.578%
2023.11.30(목)	190.0	190.4	3.65%	3.670%	3.657%		3.84%	3.583%	3.621%
2023.12.01(금)	200.6	190.8	3.60%	3.552%	3.610%		3.84%	3.587%	3.622%
2023.12.04(월)	200.4	193.7	3.57%	3.556%	3.585%		3.84%	3.531%	3.559%
2023.12.05(화)	192.1		3.57%	3.549%	3.594%		3.84%	3.484%	3.518%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

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)
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)	2022.04.14(목)	1.50% (▲0.25)
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)	2022.02.24(목)	1.25% (동결)

한국은행 공개시장운영 잔액

◎ RP매입

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.12.05(화)	14:00~14:10	6	2023.12.11(월)	13.70	3.50%	2.50	18.2%	2023-062-006

◎ RP매각

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.11.30(목)	14:00~14:10	7	2023.12.07(목)	21.90	3.50%	0.50	2.3%	2023-061-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2023.11.14(화)	14:00~14:10	28	2023.12.12(화)	0.30	0.85	3.47%	0.30	2023-0040-0028
2023.11.21(화)	14:00~14:10	28	2023.12.19(화)	0.30	0.94	3.48%	0.30	2023-0041-0028
2023.11.28(화)	14:00~14:10	28	2023.12.26(화)	0.30	0.71	3.48%	0.30	2023-0042-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	LS머트리얼즈	울트라캐패시터(UC) 제조 기업	2023.12.01(금) ~ 2023.12.04(월)	2023.12.06(수)	12.77조 - 키움(5.7조), KB(5.5조) 이베스트(0.7조), 하이(0.5조), NH(0.35조)
공모주	블루엠텍	의약품 이커머스 기업	2023.12.04(월) ~ 2023.12.05(화)	2023.12.07(목)	2.66조 - 하나(1.99조), 키움(6,700억)
실권주	누리플랜	환경 정화장치 및 조명 제조 기업	2023.12.07(목) ~ 2023.12.08(금)	2023.12.12(화)	SK
실권주	아미코젠	바이오 및 헬스케어 전문 기업	2023.12.07(목) ~ 2023.12.08(금)	2023.12.12(화)	NH, 한양

관련 정보

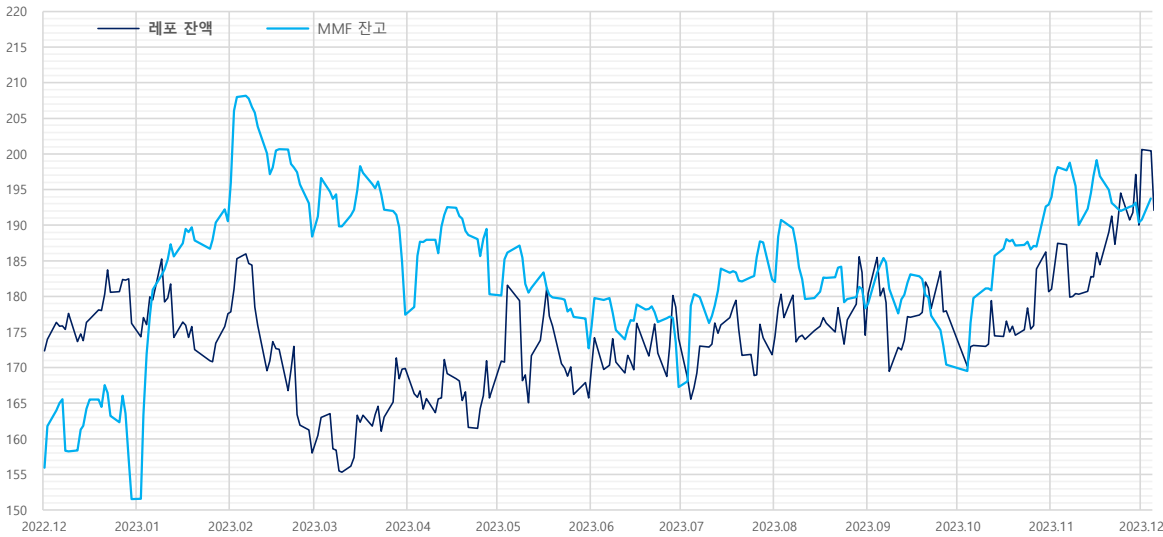
기준일	2023.12.06(수)	금통위	2024.01.11(목)	FOMC	2023.12.13(화) ~ 2023.12.14(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 2024년 기준 계산, 적립기간, 금통위 및 FOMC 예정 일정표						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	
2023년 11월	2023.11.01(수)	2023.11.30(목)	2023.12.07(목)	2024.01.10(수)	2023.11.30(목)	2023.11.09(목)		
2023년 12월	2023.12.01(금)	2023.12.31(일)	01.11(목)	02.07(수)		2023.12.14(목)	2023.12.28(목)	2023.12.12(화) ~ 2023.12.13(수)
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)		09.12(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



월말일 MMF 증감내역			
해당연월	MMF	전일대비	전월대비
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

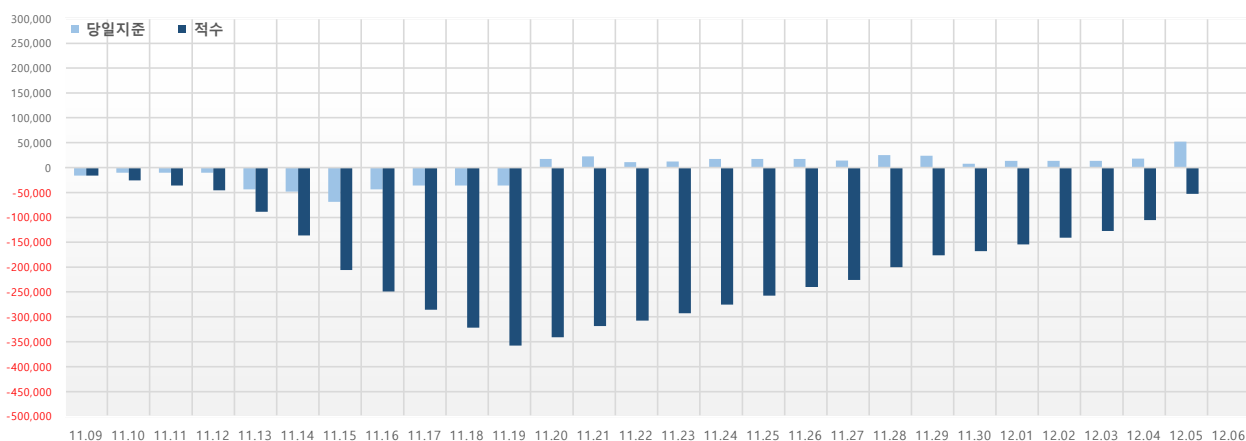


기준금리 추이			단위 : %P	
2023년	2022년	2021년		
11.30(목)	3.50% (동결)	11.24(목)	3.25%	(▲0.25)
10.19(목)	3.50% (동결)	10.12(수)	3.00%	(▲0.50)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50%	(▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25%	(▲0.50)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	1.75%	(▲0.25)
04.11(화)	3.50% (동결)	04.14(목)	1.50%	(▲0.25)
02.23(목)	3.50% (동결)	02.24(목)	1.25%	(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
11.09(목)	-16,159	-16,159
11.10(금)	-9,939	-25,702
11.11(토)	-9,939	-35,641
11.12(일)	-9,939	-45,580
11.13(월)	-43,427	-89,007
11.14(화)	-48,059	-136,432
11.15(수)	-68,589	-205,835
11.16(목)	-43,432	-248,736
11.17(금)	-36,258	-285,179
11.18(토)	-36,258	-321,437
11.19(일)	-36,258	-357,695
11.20(월)	17,063	-340,999
11.21(화)	22,373	-318,500
11.22(수)	11,037	-307,559
11.23(목)	12,174	-292,484
11.24(금)	17,447	-275,042
11.25(토)	17,447	-257,595
11.26(일)	17,447	-240,148
11.27(월)	14,325	-225,830
11.28(화)	25,066	-200,145
11.29(수)	24,072	-176,072
11.30(목)	8,067	-168,003
12.01(금)	13,612	-154,495
12.02(토)	13,612	-140,883
12.03(일)	13,612	-127,271
12.04(월)	18,103	-105,056
12.05(화)	52,386	-52,676
12.06(수)		