

레포 시장동향

◎ 전일

LS머트리얼즈 청약 환불 영향으로 증권사 매도 급증했으며, 유동성 충분치 않아 장 막판까지 정체 지속되었음. 기준일 은행 간 콜 조정 후 소폭 잉여 마감함.

◎ 금일

국고금 유출입 혼재한 가운데 별다른 자금 개선요인 없어 빠듯한 장세 유지되었으며, 은행권 운용 강도에 따라 부족세 결정될 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.12.06 (수)				2023.12.07 (목)					
재정 [국방부0.9 국세환급0.6 실시간0.3]		18,000		한은RP매각 만기(7일)			5,000		
자금조정예금 만기		7,000		공자기금			16,000		
				재정 [국세환급0.4 실시간0.6]			10,000		
				자금조정예금 만기			3,000		
공자기금 환수		-1,000		한은RP매각(7일)			-5,000		
국고여유자금 환수		-12,000		통안채 발행(2년), 낙찰수익률 3.495%			-20,000		
세입		-6,000		국고채 발행(2년)			-4,000		
자금조정예금		-3,000		국고여유자금 환수			-18,000		
기타		-2,000		세입			-4,000		
				자금조정예금			-5,000		
전일 기준	지준	53,628	적수	948	금일 예상	지준	32,000	적수	32,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.11.30(목)	190.0	190.4	3.65%	3.670%	3.657%	3.500%	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	193.0	3.57%	3.549%	3.594%		3.84%	3.484%	3.518%
2023.12.06(수)	196.3		3.57%	3.516%	3.592%		3.84%	3.463%	3.482%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

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)	2022.05.26(목)	1.75% (▲0.25)
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)	2022.04.14(목)	1.50% (▲0.25)
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)	2022.02.24(목)	1.25% (동 결)

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	블루앤틱	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

지준일	2024.01.10(수)	금통위	2024.01.11(목)	FOMC	2023.12.13(화) ~ 2023.12.14(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, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 2024년 지준 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

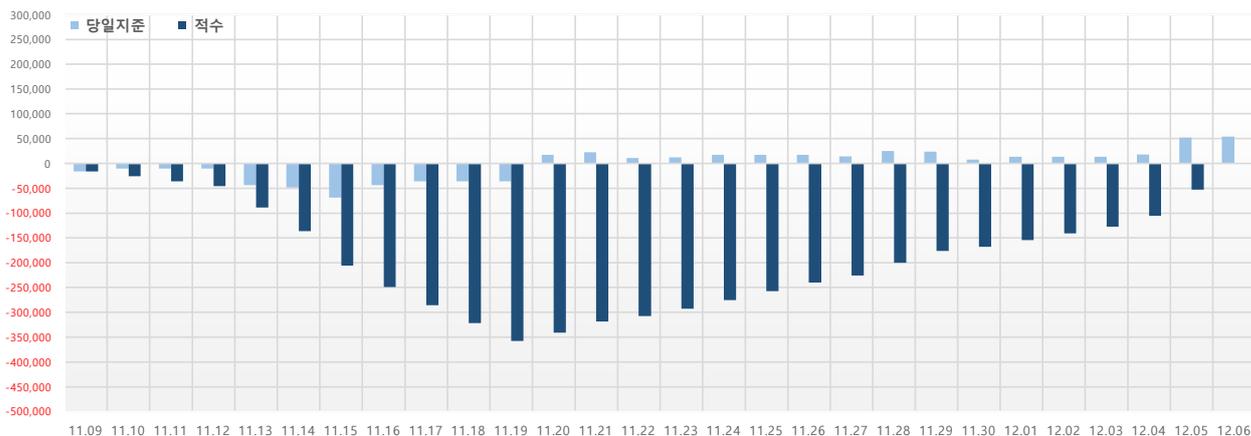


기준금리 추이			단위 : %P	
2023년	2022년	2021년		
11.30(목)	3.50% (동결)	11.24(목)	3.25%	(▲0.25)
10.19(목)	3.50% (동결)	10.12(수)	3.00%	(▲0.50)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50%	(▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25%	(▲0.50)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	1.75%	(▲0.25)
04.11(화)	3.50% (동결)	04.14(목)	1.50%	(▲0.25)
02.23(목)	3.50% (동결)	02.24(금)	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)	53,628	948