

레포 시장동향

◎ 전주

주초 시은 조달 증가하여 대규모 국고 유입됐음에도 수급 빠듯했고, 지준일과 청약 환불일이 겹쳐 LS머테리얼 흥행에도 불구하고 유동성 개선효과 크지 않았음. 한은RP매입 이후 마감일 은행 간 콜 및 레포 조정을 통해 안전히 마감한 반면, 환불일 증권사 추가 매도 급증하여 장 막판까지 조달 쉽지 않았음. 차주 국고채 만기에 앞서 국고 및 공자기금 대거 환수되어 은행권 매수 의존도 매우 높았으며, 추가 한은RP매입을 통해 유동성 지원했음에도 조달금리 급등하였음.

◎ 금일

국고채 만기 규모 상당하나 은행권 적수 부담으로 운용에 적극적이지 않아 부족세 지속될 전망. 익일물 및 기일물 조달금리 높게 유지되었음.

지준 증감 요인

단위: 억 원

2023.12.08 (금)				2023.12.11 (월)				
한은RP매입(5일)		50,000		국고채 만기 및 이자			252,000	
재정 [국채환급0.5 실시간1.6]		21,000		재정 [국채환급0.8 실시간1.5]			23,000	
자금조정예금 만기		4,000		자금조정예금 만기			3,000	
공자기금 환수		-215,000		한은RP매입 만기(6일)			-25,000	
국고여유자금 환수		-35,000		국고채 발행(50년)			-1,000	
제기금 환수		-17,000		공자기금 환수			-1,000	
세입		-5,000		국고여유자금 환수			-30,000	
자금조정예금		-3,000		세입			-6,000	
기타		-2,000		자금조정예금			-3,000	
				기타			-9,000	
전일 기준	지준	-174,440	적수	금일 예상	지준	29,000	적수	-119,000

Market Data

단위: 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.12.04(월)	200.4	193.7	3.57%	3.556%	3.585%	3.500%	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	192.4	3.57%	3.516%	3.592%		3.84%	3.463%	3.482%
2023.12.07(목)	197.5	191.6	3.57%	3.618%	3.587%		3.84%	3.511%	3.520%
2023.12.11(월)	196.4		3.63%	3.683%	3.685%		3.84%	3.461%	3.479%

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
2023.12.08(금)	14:00~14:10	5	2023.12.13(수)	21.44	3.50%	5.00	23.3%	2023-064-005

◎ RP매각

단위: 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.12.07(목)	14:00~14:10	7	2023.12.14(목)	31.20	3.50%	0.50	1.6%	2023-063-007

◎ 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)
실권주	누리플랜	환경 정화장치 및 조명 제조 기업	2023.12.07(목) ~ 2023.12.08(금)	2023.12.12(화)	SK (4,900억)
실권주	라이프시맨틱스	디지털 헬스케어 전문 기업	2023.12.11(월) ~ 2023.12.12(화)	2023.12.14(목)	한투
실권주	삼화전자공업	페라이트 코어 제조 기업	2023.12.12(화) ~ 2023.12.13(수)	2023.12.15(금)	NH
실권주	메드팩토	신약 연구 및 개발 기업	2023.12.12(화) ~ 2023.12.13(수)	2023.12.15(금)	삼성, 한양
공모주	IBKS제23호스팩	기업인수목적회사	2023.12.12(화) ~ 2023.12.13(수)	2023.12.15(금)	IBK
공모주	키움제9호스팩	기업인수목적회사	2023.12.12(화) ~ 2023.12.13(수)	2023.12.15(금)	키움
공모주	하나제30호스팩	기업인수목적회사	2023.12.13(수) ~ 2023.12.14(화)	2023.12.18(월)	삼성
공모주	STX	글로벌 종합상사	2023.12.13(수) ~ 2023.12.14(화)	2023.12.18(월)	신한, BNK
공모주	디에스단석	친환경 재생에너지 전문 기업	2023.12.14(목) ~ 2023.12.15(금)	2023.12.19(화)	KB, NH

관련 정보

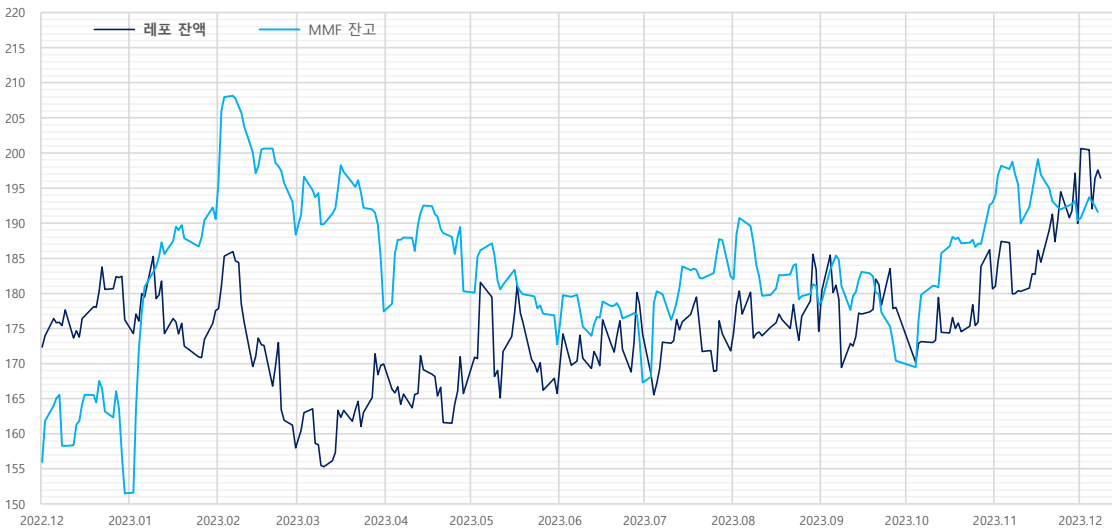
지준일	2024.01.10(수)	금통위	2024.01.11(목)	FOMC	2023.12.13(화) ~ 2023.12.14(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlId=10078655&menuNo=200690		무위험저표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttlId=10068266&menuNo=200460		증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 2024년 지준 계산, 적립기간, 금통위 및 FOMC 예정 일정표				www.traditionkorea.com/marketConditions.html?sca=0&stx=&stx=&page=1&sca=1		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)		2023.12.12(화) ~ 2023.12.13(수) 01.30(화) ~ 01.31(수)
2023년 12월	2023.12.01(금)	2023.12.31(일)	01.11(목)	02.07(수)		2023.12.14(목)	2023.12.28(목)	
2024년 1월	01.01(월)	01.31(수)	02.08(목)	03.06(수)	01.11(목)	01.25(목)		
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)	
2024년 4월	04.01(월)	04.30(화)	05.09(목)	06.05(수)	04.12(금)	04.25(목)		
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)	
2024년 7월	07.01(월)	07.31(수)	08.08(목)	09.11(수)	07.11(목)	07.18(목)		
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)	
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)		
2024년 12월	12.01(일)	12.31(화)	2025.01.09(목)	2025.02.05(수)		12.12(목)	12.24(화)	

레포 거래잔액 및 MMF 잔고 추이

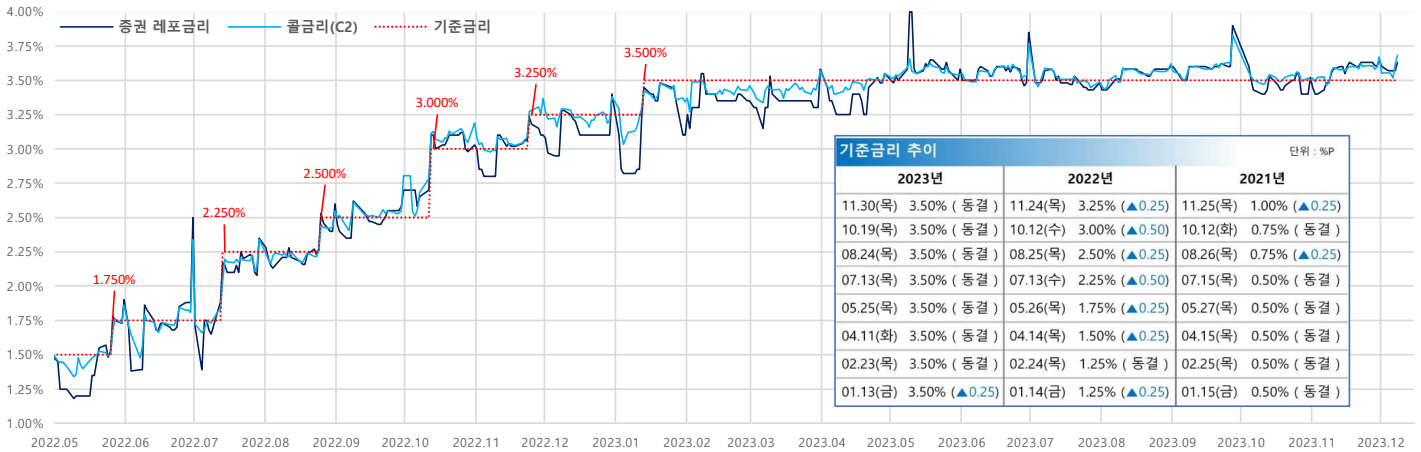
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전월대비	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

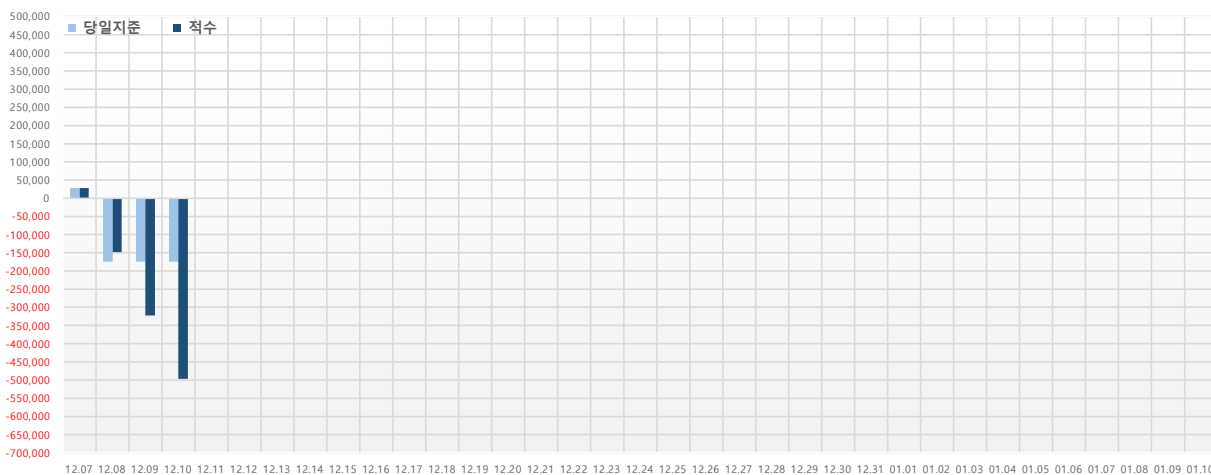


기준금리 추이				단위 : %P
2023년	2022년	2021년		
11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)		
10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)		
08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)		
07.13(목) 3.50% (동결)	07.13(수) 2.25% (▲0.50)	07.15(목) 0.50% (동결)		
05.25(목) 3.50% (동결)	05.26(목) 1.75% (▲0.25)	05.27(목) 0.50% (동결)		
04.11(화) 3.50% (동결)	04.14(목) 1.50% (▲0.25)	04.15(목) 0.50% (동결)		
02.23(목) 3.50% (동결)	02.24(목) 1.25% (동결)	02.25(목) 0.50% (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	
12.07(목)	28,035	28,035
12.08(금)	-174,440	-147,792
12.09(토)	-174,440	-322,232
12.10(일)	-174,440	-496,672
12.11(월)		
12.12(화)		
12.13(수)		
12.14(목)		
12.15(금)		
12.16(토)		
12.17(일)		
12.18(월)		
12.19(화)		
12.20(수)		
12.21(목)		
12.22(금)		
12.23(토)		
12.24(일)		
12.25(월)		
12.26(화)		
12.27(수)		
12.28(목)		
12.29(금)		
12.30(토)		
12.31(일)		
01.01(월)		
01.02(화)		
01.03(수)		
01.04(목)		
01.05(금)		
01.06(토)		
01.07(일)		
01.08(월)		
01.09(화)		
01.10(수)		