

Repo Market Report

2023.12.19 (화)



자금시장부 6021-5832

레포 시장동향

◎ 전일

국고금 환수 계속된 가운데 청약자금 운용 규모 크지 않아 금리 소폭 상승하였음. 은행 및 운용사 매수 증가하여 정체 빠르게 해소되었으며, 오후에 잉여 전환되었음.

◎ 금일

국고 및 제기금 환수와 더불어 청약(디에스단석) 환불 영향으로 빠듯한 장세 지속되었음. 은행권 운용 여부에 따라 분위기 가변적이겠으며, 금리 높은 수준 유지될 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.12.18 (월)				2023.12.19 (화)			
재정 [실시간]		19,000		통안계정 만기(28일)			3,000
자금조정예금 만기		3,000		통안채 만기(91일)			10,600
				공자기금			6,000
				재정 [복지부2.5 경찰청0.5 국세환급0.1 실시간1.4]			45,000
				자금조정예금 만기			3,000
공자기금 환수		-7,000		통안계정(28일)			-3,000
세입 [총부세 등]		-11,000		통안채 발행(91일), 낙찰수익률 3.500% 낙찰할인율 3.469%			-5,000
자금조정예금		-3,000		국고채 발행(5년)			-6,000
				국고여유자금 환수			-9,000
				제기금 환수			-6,000
				세입 [총부세 등]			-31,000
				자금조정예금			-3,000
전일 기준	지준	-28,337	적수	-630,387	금일 예상	지준	-24,000
						적수	-654,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.12.12(화)	196.2	185.5	3.67%	3.686%	3.701%	3.500%	3.84%	3.446%	3.491%
2023.12.13(수)	197.5	185.6	3.70%	3.655%	3.715%		3.84%	3.465%	3.500%
2023.12.14(목)	198.6	186.1	3.73%	3.674%	3.732%		3.83%	3.258%	3.288%
2023.12.15(금)	197.5	187.7	3.73%	3.649%	3.735%		3.83%	3.281%	3.312%
2023.12.18(월)	196.4		3.75%	3.690%	3.751%		3.83%	3.277%	3.301%

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

◎ RP매각

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.12.14(목)	14:00~14:10	7	2023.12.21(목)	34.60	3.50%	0.50	1.4%	2023-065-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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
2023.12.12(화)	14:00~14:10	28	2024.01.09(화)	0.30	0.51	3.48%	0.30	2023-0043-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	디에스단석	친환경 재생에너지 전문 기업	2023.12.14(목) ~ 2023.12.15(금)	2023.12.19(화)	15조 - KB (10.1조), NH (4.9조)
CB	이슈앤지스	희귀질환 치료제 개발 기업	2023.12.19(화) ~ 2023.12.20(수)	2023.12.22(금)	한투
실권주	엠젠솔루션	바이오 및 네트워크 기업	2023.12.19(화) ~ 2023.12.20(수)	2023.12.21(목)	상상인

관련 정보

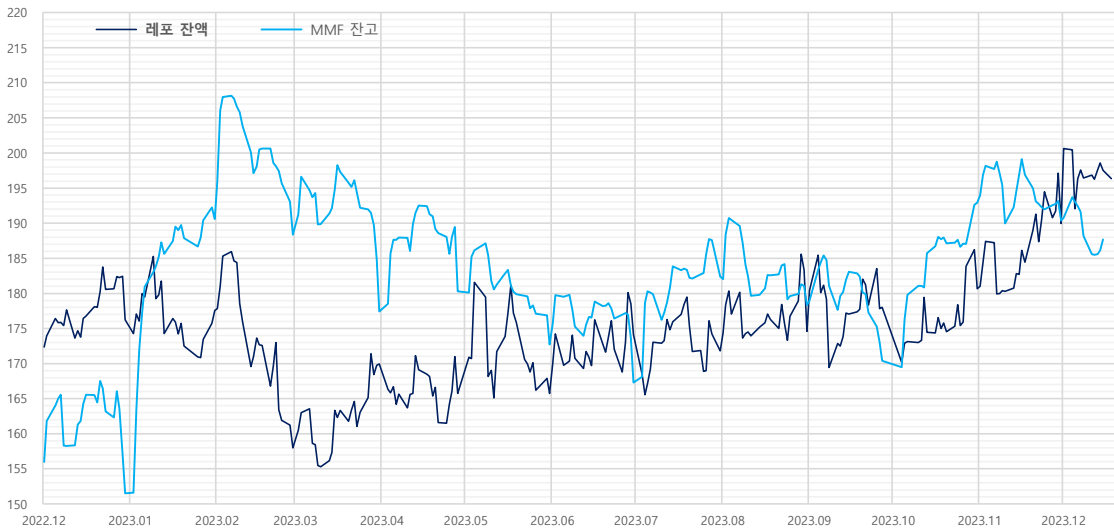
지준일	2024.01.10(수)	금통위	2024.01.11(목)	FOMC	2024.01.30(화) ~ 2024.01.31(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr	
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr	
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttId=10078655&menuNo=200690	무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttId=10068266&menuNo=200460	증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 한국은행, 2024년 지준 계산기간 및 적립기간						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000561/view.do?nttId=10080957&menuNo=200037	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

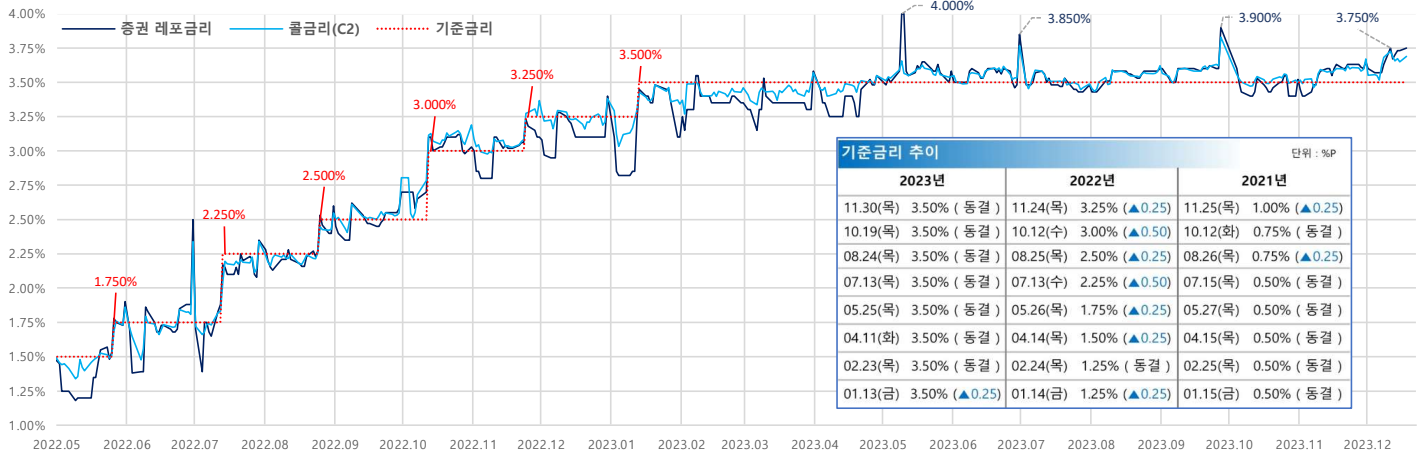
단위 : 조 원



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

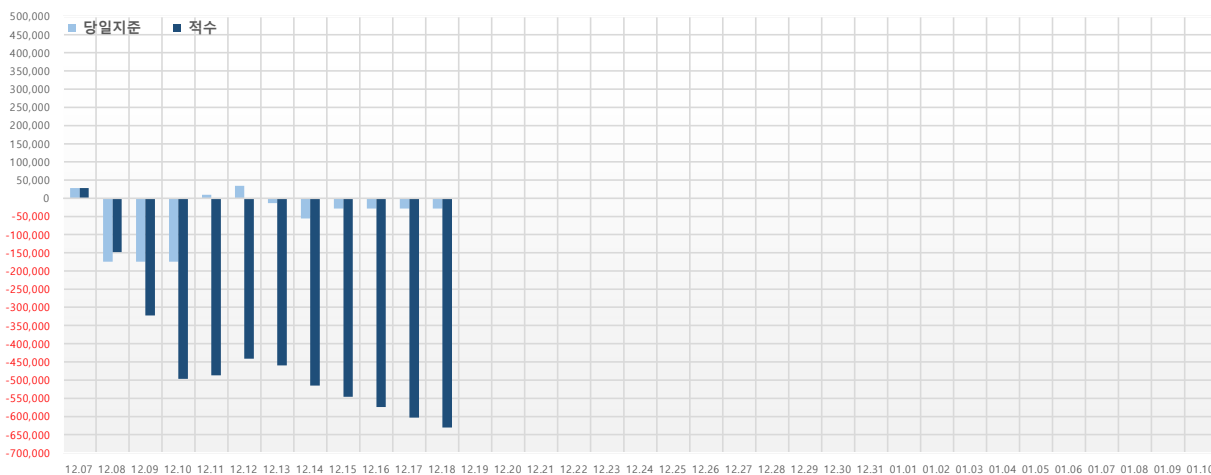


기준금리 추이				단위 : %P
2023년	2022년	2021년		
11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)		
10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)		
08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)		
07.13(목) 3.50% (동결)	07.13(수) 2.25% (▲0.50)	07.15(목) 0.50% (동결)		
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
12.08(금)	-174,440
12.09(토)	-174,440
12.10(일)	-174,440
12.11(월)	9,428
12.12(화)	34,646
12.13(수)	-13,477
12.14(목)	-55,646
12.15(금)	-28,924
12.16(토)	-28,924
12.17(일)	-28,924
12.18(월)	-28,337
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)	