

## Repo Market Report

2023.12.20 (수)

Tradition

자금시장부 6021-5832

## 레포 시장동향

## ◎ 전일

국고여유자금 추가 환수 및 공모주 청약 환불 영향으로 금리 보합 출발했으나 장 초반부터 은행권 매수에 적극적으로 나서 수급 원활하였음.

## ◎ 금일

기일을 매칭에 따른 익일물 매도 감소 예상되나 국고금 환수 영향으로 타이트한 장세 이어지겠음. 한은RP매입 및 은행권 운용 여부에 따라 분위기 가변적일 전망.

## 지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.12.19 (화)				2023.12.20 (수)				
통안계정 만기(28일)		3,000		한은RP매입			-	
통안채 만기(91일)		10,600		재정 [국세환급0.1   실시간2.8]			29,000	
공자기금		6,000		자금조정예금 만기			3,000	
재정 [복지부2.5   경찰청0.4   국세환급0.1   실시간1.7]		47,000						
자금조정예금 만기		3,000						
기타		3,000						
통안계정(28일)		-3,000		공자기금 환수			-9,000	
통안채 발행(91일), 낙찰수익률 3.500%   낙찰할인율 3.469%		-5,000		국고여유자금 환수			-2,000	
국고채 발행(5년)		-6,000		국고채 발행(20년)			-2,000	
국고여유자금 환수		-15,000		세입			-14,000	
세입 [종부세 등]		-31,000		자금조정예금			-3,000	
자금조정예금		-3,000						
전일 기준	지준	-18,428	적수	금일 예상	지준	-16,000	적수	-660,000

## Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.12.13(수)	197.5	185.6	3.70%	3.655%	3.715%	3.500%	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	188.7	3.75%	3.690%	3.751%		3.83%	3.277%	3.301%
2023.12.19(화)	199.4		3.75%	3.719%	3.747%		3.83%	3.296%	3.307%

## 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

## ◎ 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

## ◎ 통화안정예금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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
2023.12.19(화)	14:00~14:10	28	2024.01.16(화)	0.30	0.41	3.47%	0.30	2023-0044-0028

## 청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
CB	이수앱지스	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 (33억)

## 관련 정보

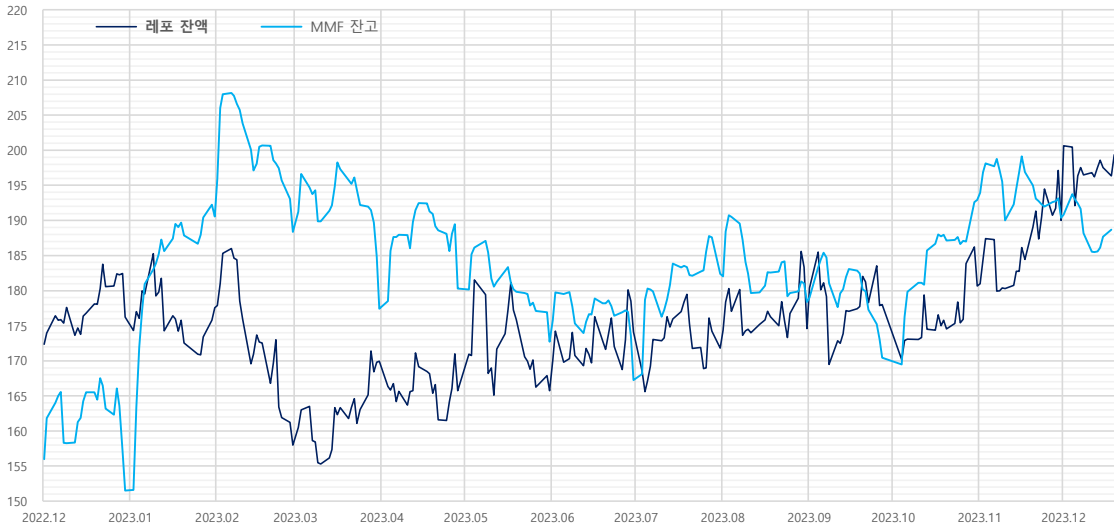
기준일	2024.01.10(수)	금통위	2024.01.11(목)	FOMC	2024.01.30(화) ~ 2024.01.31(수)	한국은행	<a href="http://www.bok.or.kr">http://www.bok.or.kr</a>	
· 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장   자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	<a href="https://ecos.bok.or.kr">https://ecos.bok.or.kr</a>	
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						<a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10078655&amp;menuNo=200690">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10078655&amp;menuNo=200690</a>	무위험저표금리	<a href="https://www.kofrc.kr">https://www.kofrc.kr</a>
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						<a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttid=10068266&amp;menuNo=200460">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttid=10068266&amp;menuNo=200460</a>	증권정보포털	<a href="https://seibro.or.kr">https://seibro.or.kr</a>
· 한국은행, 2024년 기준 계산기간 및 적립기간						<a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000561/view.do?nttid=10080957&amp;menuNo=200037">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000561/view.do?nttid=10080957&amp;menuNo=200037</a>	금융투자협회	<a href="https://kofiabond.or.kr">https://kofiabond.or.kr</a>

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)	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

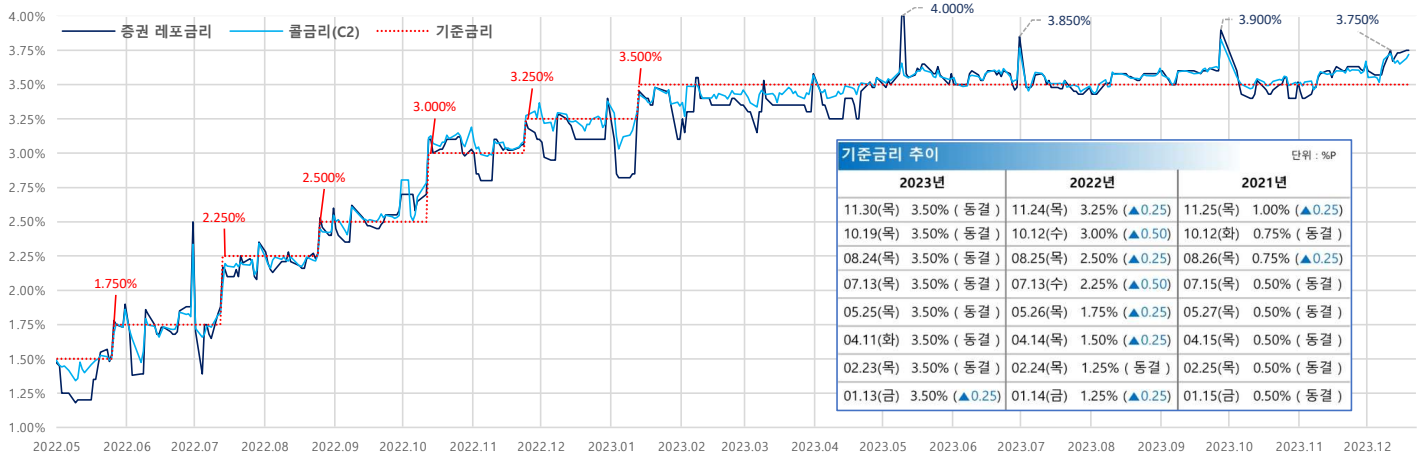
단위 : 조 원



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

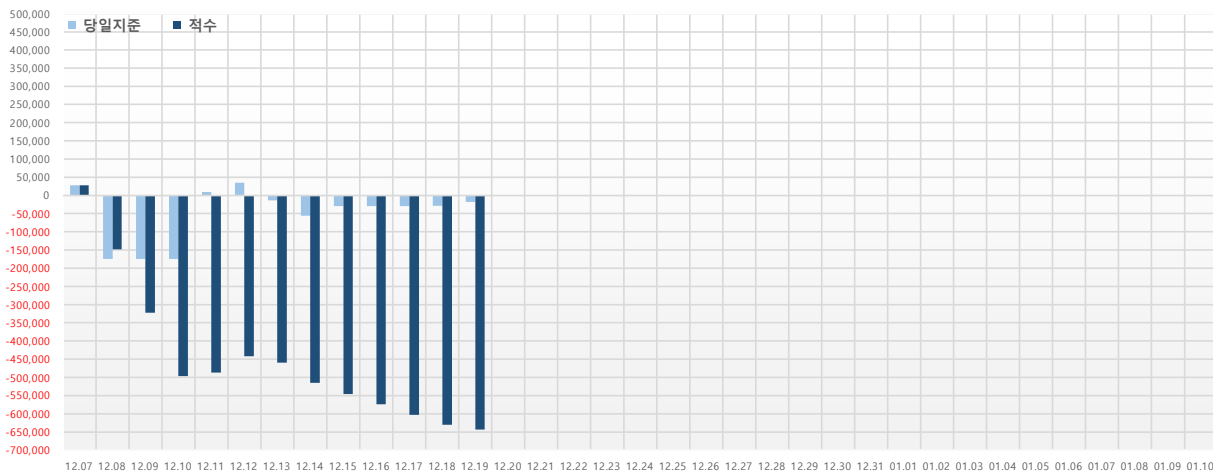


기준금리 추이			단위 : %P		
2023년	2022년	2021년			
11.30(목)	3.50% (동결)	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	3.50% (동결)	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	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)	9,428	-487,173
12.12(화)	34,646	-441,443
12.13(수)	-13,477	-459,443
12.14(목)	-55,646	-515,096
12.15(금)	-28,924	-545,148
12.16(토)	-28,924	-574,072
12.17(일)	-28,924	-602,996
12.18(월)	-28,337	-630,387
12.19(화)	-18,428	-643,126
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)		