

레포 시장동향

- ◎ 전일
기일물 매칭에 따른 익일물 매도 감소 영향으로 금리 하락 출발했으며, 한은RP매입을 통한 유동성 지원까지 단행되어 조달여건 양호하였음.
- ◎ 금일
연말 앞두고 국고금 환수 및 MMF 환매 계속되어 빠듯한 장세 이어지겠음. 은행권 매수 의존도 매우 높겠으며, 회사채 해소 쉽지 않을 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.12.20 (수)				2023.12.21 (목)			
한은RP매입(7일)		60,000		한은RP매각 만기(7일)			5,000
재정 [국방부0.6 국세환급0.1 실시간1.7]		24,000		통안채 중도환매			6,200
국고여유자금		3,000		재정 [국세환급0.1 실시간1.7]			18,000
자금조정예금 만기		3,000		자금조정예금 만기			5,000
공자기금 환수		-7,000		한은RP매각(7일)			-5,000
국고채 발행(20년)		-2,000		통안채 발행(3년), 낙찰수익률 3.370%			-7,000
세입		-16,000		공자기금 환수			-1,000
자금조정예금		-5,000		국고여유자금 환수			-15,000
기타		-5,000		제기금 환수			-3,000
				세입			-5,000
				자금조정예금			-5,000
전일 기준	지준	37,058	적수	금일 예상	지준	30,000	적수
			-608,687				-578,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.12.14(목)	198.6	186.1	3.73%	3.674%	3.732%	3.500%	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	184.8	3.75%	3.719%	3.747%		3.83%	3.296%	3.307%
2023.12.20(수)	195.4		3.70%	3.686%	3.699%		3.83%	3.232%	3.250%

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	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2023.12.20(수)	11:00~11:10	7	2023.12.27(수)	6.00	16.12	3.60%	6.00	2023-066-007

◎ 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

◎ 통화안정예금예치금

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	이수업지스	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 (953억)

관련 정보

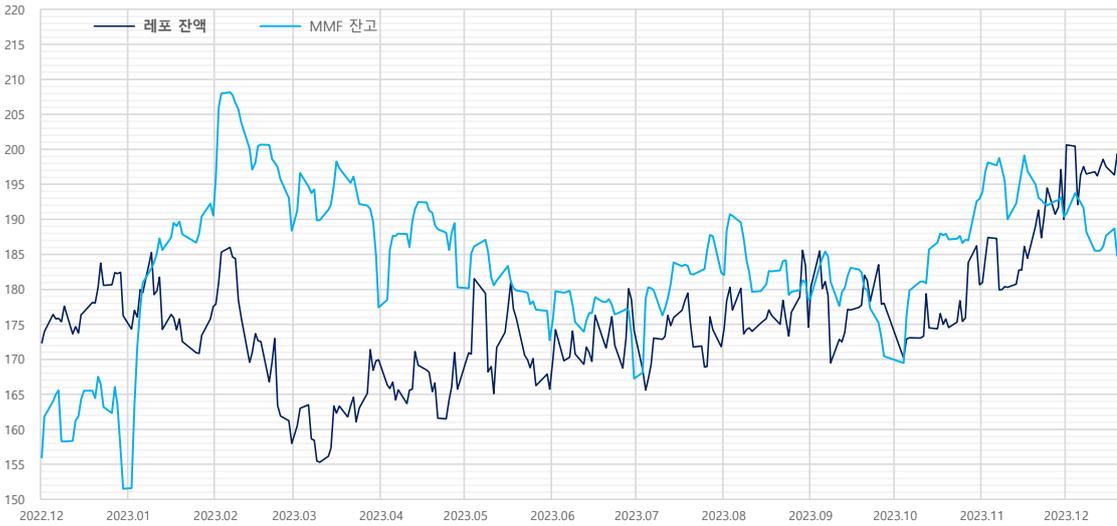
지준일	2024.01.10(수)	금통위	2024.01.11(목)	FOMC	2024.01.30(화) ~ 2024.01.31(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						무위험저표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 한국은행, 2024년 지준 계산기간 및 적립기간						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)	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

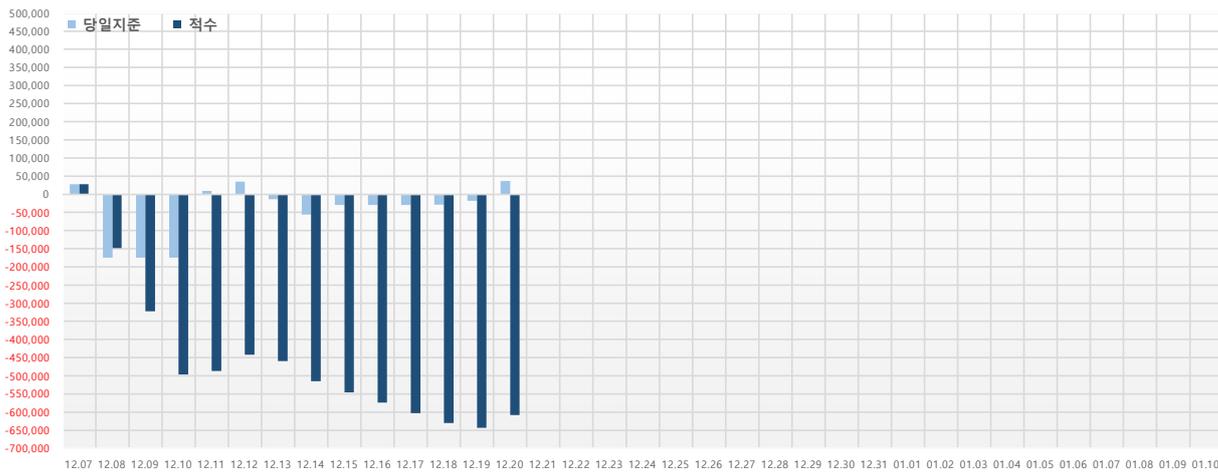


기준금리 추이			단위 : %P		
2023년	2022년	2021년	2023년	2022년	2021년
11.30(목)	3.50%	(동결)	11.24(목)	3.25%	(▲0.25)
10.19(목)	3.50%	(동결)	10.12(수)	3.00%	(▲0.50)
08.24(목)	3.50%	(동결)	08.25(목)	2.50%	(▲0.25)
07.13(목)	3.50%	(동결)	07.13(수)	2.25%	(▲0.50)
05.25(목)	3.50%	(동결)	05.26(목)	1.75%	(▲0.25)
04.11(화)	3.50%	(동결)	04.14(목)	1.50%	(▲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	
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)	37,058	-608,687
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)		