

레포 시장동향

◎ 전일

국고금 환수 이어졌으나 기일물 매칭에 따른 익일물 매도 감소와 은행권 매수 참여에 힘입어 금리 하락하였음. 연말 대비를 위한 기일물 및 선네고 수요 증가세 보임.

◎ 금일

국고금 추가 환수 예정되어 있어 시장 유동성 전일과 비슷하겠음. 당일지준 흐름 양호하여 은행권 매수 꾸준할 것으로 기대되며, 담보채권별 조달여건 상이할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.12.21 (목)				2023.12.22 (금)					
한은RP매각 만기(7일)		5,000		재정 [국세환급0.2 실시간1.9]			21,000		
통안채 중도환매		6,200		자금조정예금 만기			4,000		
재정 [국세환급0.1 실시간2.2]		23,000							
자금조정예금 만기		5,000							
기타		1,000							
한은RP매각(7일)		-5,000		공자기금 환수			-2,000		
통안채 발행(3년), 낙찰수익률 3.370%		-7,000		국고여유자금 환수			-10,000		
공자기금 환수		-1,000		세입			-7,000		
국고여유자금 환수		-21,000		자금조정예금			-3,000		
세입		-5,000							
자금조정예금		-4,000							
전일 기준	지준	34,044	적수	-557,120	금일 예상	지준	37,000	적수	-521,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.12.15(금)	197.5	187.7	3.73%	3.649%	3.735%	3.500%	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	185.4	3.70%	3.686%	3.699%		3.83%	3.232%	3.250%
2023.12.21(목)	196.3		3.60%	3.629%	3.618%		3.83%	3.236%	3.255%

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
2023.12.21(목)	14:00~14:10	7	2023.12.28(목)	30.20	3.50%	0.50	1.7%	2023-067-007

◎ 통화안정예정예치금

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	애니젠	팹타이드 바이오소재 개발 기업	2023.12.27(수) ~ 2023.12.28(목)	2024.01.02(화)	신한

관련 정보

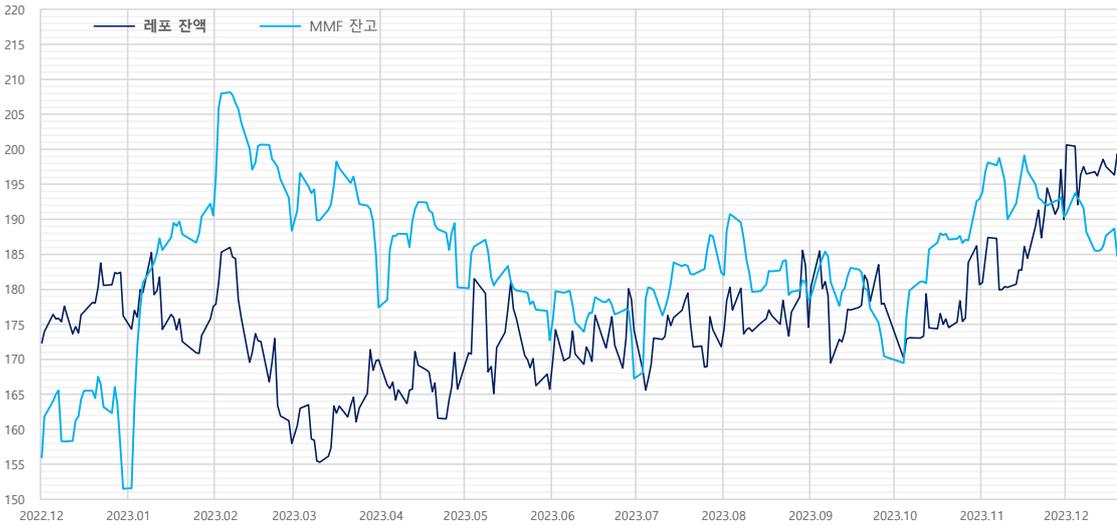
지준일	2024.01.10(수)	금통위	2024.01.11(목)	FOMC	2024.01.30(화) ~ 2024.01.31(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10078655&menuNo=200690		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)	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

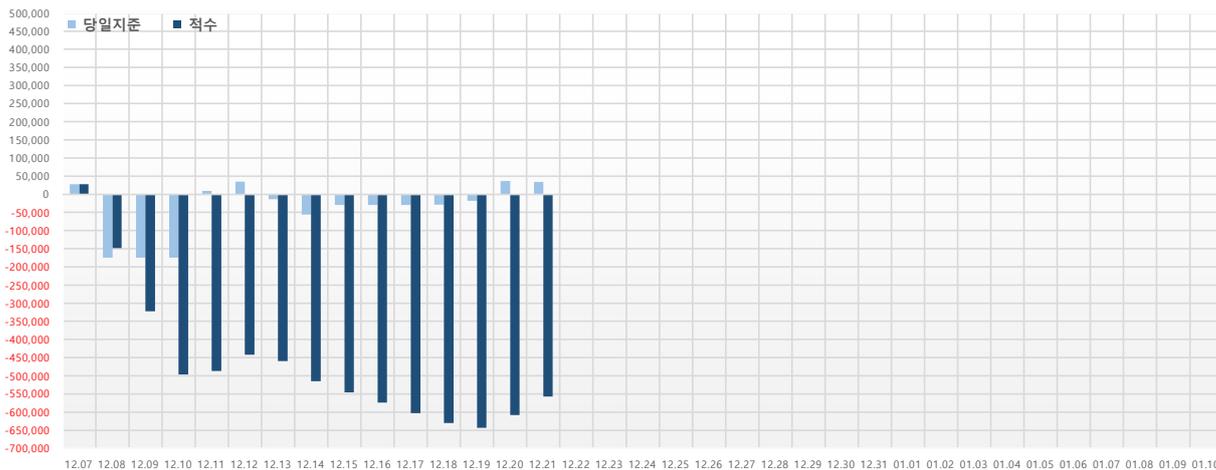


기준금리 추이			단위 : %P			
2023년	2022년	2021년	2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	3.50%	3.25%	(▲0.25)	11.25(목)	1.00%	(▲0.25)
10.19(목)	3.50%	3.00%	(▲0.50)	10.12(화)	0.75%	(동결)
08.24(목)	3.50%	2.50%	(▲0.25)	08.26(목)	0.75%	(▲0.25)
07.13(목)	3.50%	2.25%	(▲0.50)	07.15(목)	0.50%	(동결)
05.25(목)	3.50%	1.75%	(▲0.25)	05.27(목)	0.50%	(동결)
04.11(화)	3.50%	1.50%	(▲0.25)	04.15(목)	0.50%	(동결)
02.23(목)	3.50%	1.25%	(동결)	02.25(목)	0.50%	(동결)
01.13(금)	3.50%	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)	34,044	-557,120
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)		