

레포 시장동향

◎ 전일

국고금 환수 계속되었으나 MMF 환매대기자금 유효하여 수급 무난하였음. 한은RP매입 증액 실시 후 은행권 조달 감소했으며, 오후에 잉여세 전환되었음.

◎ 금일

전일 한은RP매입으로 유동성 추가 공급되어 은행권 조달 감소하겠으며, 행안 및 실시간 재정 유입으로 운용 여력 증대되어 조달여건 대체로 양호할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.12.27 (수)				2023.12.28 (목)			
한은RP매입(8일)		80,000		한은RP매각 만기(7일)		5,000	
재정 [국방부0.5 국세환급0.1 실시간2.2]		28,000		재정 [행안부3.1 국세환급1.0 실시간3.2]		73,000	
자금조정예금 만기		6,000		자금조정예금 만기		10,000	
한은RP매입 만기(7일)		-60,000		한은RP매각(7일)		-5,000	
공자기금 환수		-1,000		공자기금 환수		-1,000	
국고여유자금 환수		-17,000		국고여유자금 환수		-48,000	
세입		-10,000		세입		-15,000	
자금조정예금		-10,000		자금조정예금		-5,000	
기타		-1,000					
전일 기준	지준	22,180	적수	금일 예상	지준	36,000	적수
			-254,328				-218,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.12.20(수)	195.4	185.4	3.70%	3.686%	3.699%	3.500%	3.83%	3.232%	3.250%
2023.12.21(목)	196.3	184.1	3.60%	3.629%	3.618%		3.83%	3.236%	3.255%
2023.12.22(금)	197.1	182.8	3.60%	3.638%	3.629%		3.83%	3.234%	3.254%
2023.12.26(화)	205.8	178.5	3.58%	3.632%	3.609%		3.83%	3.221%	3.227%
2023.12.27(수)	204.1		3.56%	3.556%	3.596%		3.83%	3.220%	3.222%

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

◎ RP매입

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	평균낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2023.12.27(수)	14:00~14:10	8	2024.01.04(목)	8.00	13.05	3.57%	8.00	2023-069-008

◎ 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

◎ 통화안정결제예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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
2023.12.26(화)	14:00~14:10	28	2024.01.23(화)	0.30	0.24	3.50%	0.24	2023-0045-0028

관련 정보

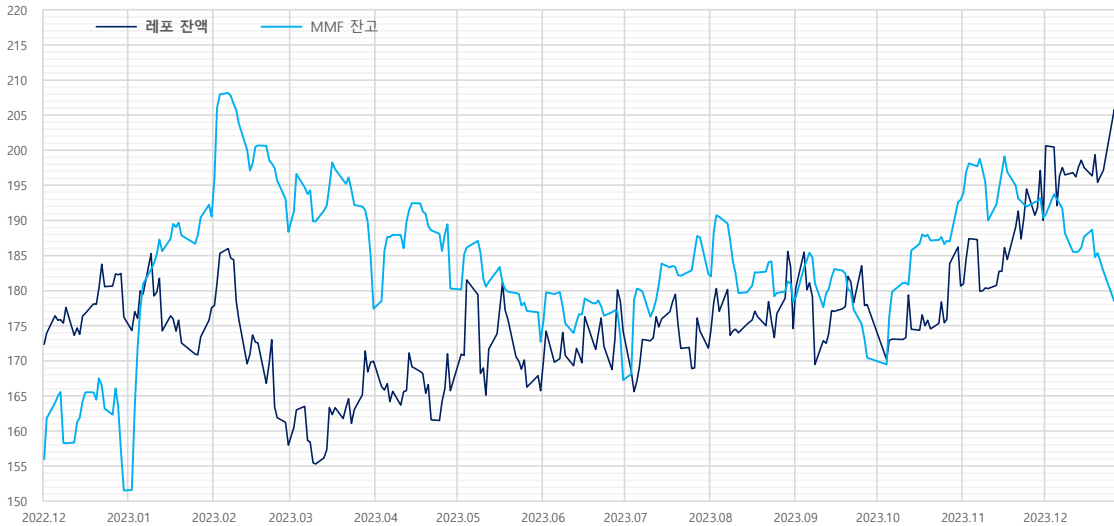
지준일	2024.01.10(수)	금통위	2024.01.11(목)	FOMC	2024.01.30(화) ~ 2024.01.31(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr	
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr	
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10078655&menuNo=200690		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)	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)	09.12(목)	10.09(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

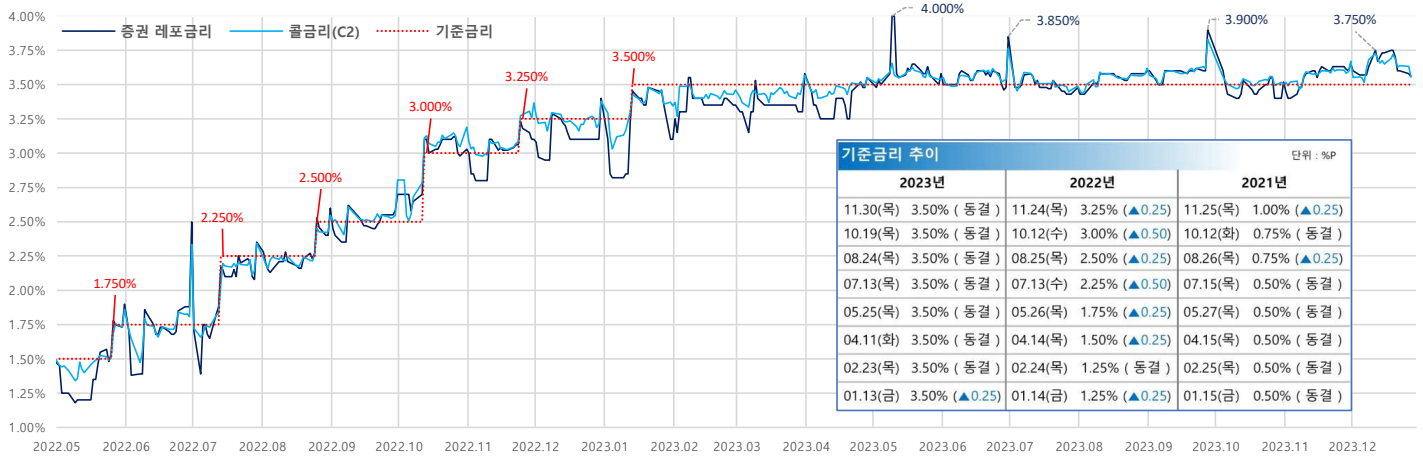
단위 : 조 원



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

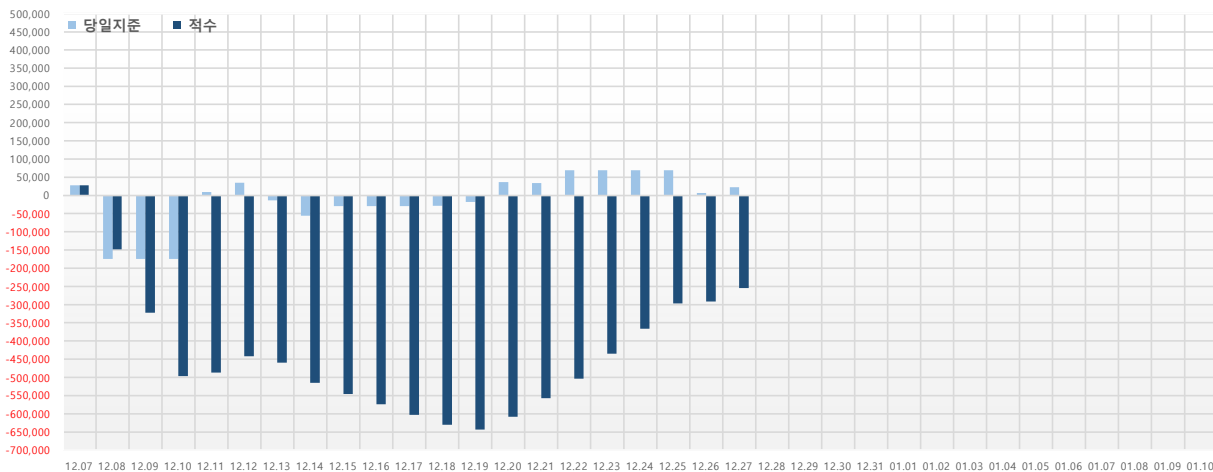


기준금리 추이			단위 : %P		
2023년	2022년	2021년			
11.30(목)	3.50% (동결)	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	3.50% (동결)	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	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)	37,058	-608,687
12.21(목)	34,044	-557,120
12.22(금)	68,871	-503,577
12.23(토)	68,871	-434,706
12.24(일)	68,871	-365,835
12.25(월)	68,871	-296,964
12.26(화)	7,246	-291,510
12.27(수)	22,180	-254,328
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)		