

레포 시장동향

◎ 전주

MMF 설정 이어져 운용사 및 은행신탁 중심 유동성 풍부했으며, 기일별 매수 불균형에 따른 일시적인 금리 상승 있었으나 주 전반에 걸쳐 잉여세 계속되었음. 잉여 마감 우려 확대되어 한국은행 비정례 RP매각을 통해 유동성 추가 흡수하였고, 기준일 은행 간 콜-레포 조정거래 후 무난히 마감하였음. 원천세 납부에 상응하는 재정 및 국고금 유입되어 조달여건 매우 양호했으나 적립기간 초반 은행권 매도 제한적이었던 관계로 잉여세 심화되었음.

◎ 금일

건보자금 유입되어 국고여유자금 환수 영향 크지 않겠음. 시장 잉여세 계속되는 가운데 은행권 조달 강도에 따라 분위기 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.01.12 (금)				2024.01.15 (월)					
국고여유자금		33,000		공자기금		7,000			
재정 [교육부6.0 복지부2.6 행안부0.6 국세환급0.1 실시간1.3]		106,000		재정 [복지부0.8 실시간1.1]		19,000			
자금조정예금 만기		11,000		자금조정예금 만기		5,000			
기타		15,000							
국고채 비경쟁인수		-7,000		국고채 발행(50년)		-6,000			
공자기금 환수		-12,000		국고여유자금 환수		-17,000			
제기금 환수		-2,000		제기금 환수		-2,000			
원천세 본납		-117,000		세입		-5,000			
자금조정예금		-5,000		자금조정예금		-5,000			
전일 기준	지준	9,010	적수	3,028	금일 예상	지준	5,000	적수	26,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.01.08(월)	197.5	200.5	3.40%	3.378%	3.410%	3.500%	3.81%	3.297%	3.312%
2024.01.09(화)	191.6	201.8	3.48%	3.416%	3.528%		3.80%	3.255%	3.274%
2024.01.10(수)	192.8	201.6	3.48%	3.503%	3.528%		3.79%	3.269%	3.297%
2024.01.11(목)	192.2	201.1	3.45%	3.393%	3.479%		3.78%	3.227%	3.257%
2024.01.12(금)	195.8		3.43%	3.432%	3.455%		3.77%	3.204%	3.241%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2024.01.11(목)	3.50% (동결)	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)
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)

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2024.01.11(목)	14:00~14:10	7	2024.01.18(목)	89.30	3.50%	0.50	0.6%	2024-003-007

◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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
2024.01.02(화)	14:00~14:10	28	2024.01.30(화)	0.70	3.02	3.43%	0.84	2024-0001-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	대신밸런스제17호스팩	기업인수목적회사	2024.01.15(월) ~ 2024.01.16(화)	2024.01.18(목)	대신
공모주	에이치비인베스트먼트	벤처캐피탈(VC)	2024.01.16(화) ~ 2024.01.17(수)	2024.01.19(금)	NH
공모주	우진엔텍	원전 계측제어설비 정비 기업	2024.01.16(화) ~ 2024.01.17(수)	2024.01.19(금)	KB
공모주	포스뱅크	포스장비, 키오스크 제조 기업	2024.01.17(수) ~ 2024.01.18(목)	2024.01.22(월)	하나
공모주	현대힙스	조선기자재 제조 기업	2024.01.17(수) ~ 2024.01.18(목)	2024.01.22(월)	미래

관련 정보

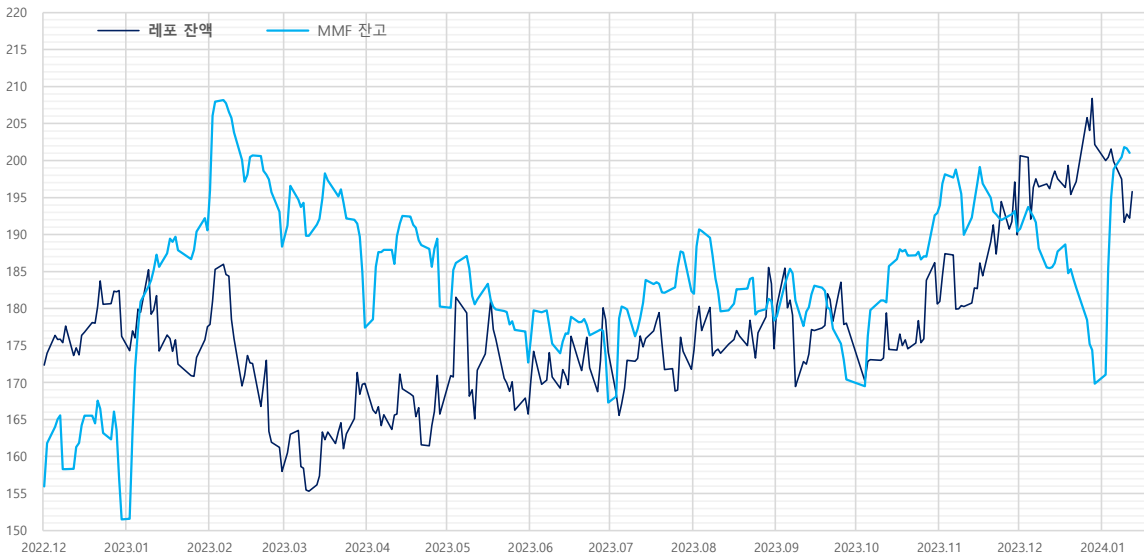
지준일	2024.02.07(수)	금통위	2024.02.22(목)	FOMC	2024.01.30(화) ~ 2024.01.31(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						증권정보포털	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 12월	2023.12.01(금)	2023.12.31(일)	01.11(목)	02.07(수)		2023.12.14(목)	2023.12.28(목)	2023.12.12(화) ~ 2023.12.13(수)
2024년 1월	01.01(월)	01.31(수)	02.08(목)	03.06(수)	01.11(목)	01.25(목)		01.30(화) ~ 01.31(수)
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

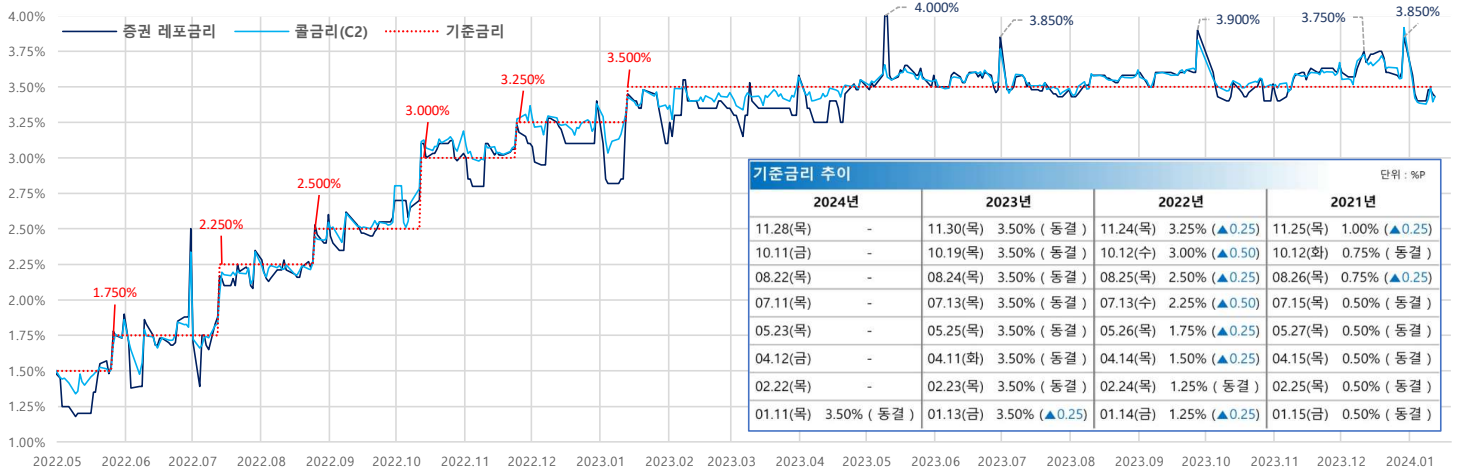
단위 : 조 원



월말일 MMF 증감내역			
해당연월	MMF	전일대비	전월대비
2023.12.29	169.8	-4.6	-20.6
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

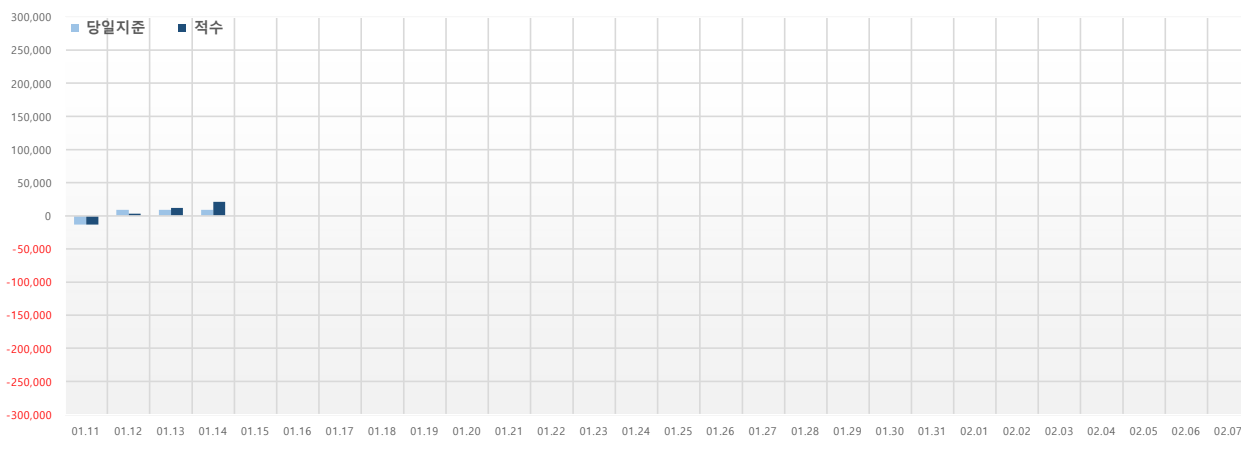


기준금리 추이				단위 : %P
2024년	2023년	2022년	2021년	
11.28(목)	-	11.30(목) 3.50% (동결)	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.11(금)	-	10.19(목) 3.50% (동결)	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.22(목)	-	08.24(목) 3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.11(목)	-	07.13(목) 3.50% (동결)	07.13(수) 2.25% (▲0.50)	07.15(목) 0.50% (동결)
05.23(목)	-	05.25(목) 3.50% (동결)	05.26(목) 1.75% (▲0.25)	05.27(목) 0.50% (동결)
04.12(금)	-	04.11(화) 3.50% (동결)	04.14(목) 1.50% (▲0.25)	04.15(목) 0.50% (동결)
02.22(목)	-	02.23(목) 3.50% (동결)	02.24(목) 1.25% (동결)	02.25(목) 0.50% (동결)
01.11(목)	3.50% (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
01.11(목)	-13,237
01.12(금)	9,010
01.13(토)	9,010
01.14(일)	9,010
01.15(월)	
01.16(화)	
01.17(수)	
01.18(목)	
01.19(금)	
01.20(토)	
01.21(일)	
01.22(월)	
01.23(화)	
01.24(수)	
01.25(목)	
01.26(금)	
01.27(토)	
01.28(일)	
01.29(월)	
01.30(화)	
01.31(수)	
02.01(목)	
02.02(금)	
02.03(토)	
02.04(일)	
02.05(월)	
02.06(화)	
02.07(수)	