

레포 시장동향

◎ 전주

주초 청약자금 운용 기대됐으나 시장 유동성 크게 개선되지 못했으며, 기일물 매수처 많지 않아 월말 대비 조달수요 증가했음에도 매칭 제한적이었음. 주간 레포금리 높게 유지된 가운데 은행권 매수 의존도 매우 높았고, 당일기준 플러스 계속되었음에도 적수 관리를 위한 시은 조달 꾸준하였음. 월말일 회사채 일부 정체를 보였으나 예상보다 수급 무난한 모습을 보였으며, 월초 운용사 및 신탁 매수 회복되어 조달여건 크게 호전되었음.

◎ 금일

월말세입 본납분에 상응하는 대규모 국고여유자금 유입되어 유동성 크게 개선될 것으로 기대됨. 지준 마감 앞두고 은행권 양방향 움직임 클 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2023.12.01 (금) | | | | 2023.12.04 (월) | | | |
|-----------------------|-----------|---------|-----------|-----------------------|-----------|----------|-----------|
| 국고여유자금 | | 12,000 | | 국고여유자금 | | 92,000 | |
| 재정 [국세환급0.1 실시간1.2] | | 13,000 | | 재정 [국세환급0.3 실시간0.4] | | 7,000 | |
| 자금조정예금 만기 | | 12,000 | | 금융중개지원대출 신규 | | 11,000 | |
| 기타 | | 4,000 | | 자금조정예금 만기 | | 5,000 | |
| 금융중개지원대출 만기 | | -12,000 | | 월말세입 본납 | | -104,000 | |
| 월말세입 선납 | | -19,000 | | 자금조정예금 | | -5,000 | |
| 자금조정예금 | | -5,000 | | | | | |
| 전일 기준 | 지준 | 13,612 | 적수 | 금일 예상 | 지준 | 19,000 | 적수 |
| | | | -154,495 | | | | -107,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2023.11.27(월) | 190.7 | 192.6 | 3.63% | 3.604% | 3.636% | 3.500% | 3.84% | 3.689% | 3.722% |
| 2023.11.28(화) | 191.7 | 192.7 | 3.61% | 3.581% | 3.620% | | 3.84% | 3.648% | 3.670% |
| 2023.11.29(수) | 197.1 | 193.2 | 3.60% | 3.595% | 3.611% | | 3.84% | 3.554% | 3.578% |
| 2023.11.30(목) | 190.0 | 190.4 | 3.65% | 3.670% | 3.657% | | 3.84% | 3.583% | 3.621% |
| 2023.12.01(금) | 200.6 | | 3.60% | 3.552% | 3.610% | | 3.84% | 3.587% | 3.622% |

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 |
|---------------|-------------|----|---------------|-------|-------|------|------|--------------|
| 2023.11.30(목) | 14:00~14:10 | 7 | 2023.12.07(목) | 21.90 | 3.50% | 0.50 | 2.3% | 2023-061-007 |

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정금액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰금액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 2023.11.14(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2023.12.12(화) | 0.30 | 0.85 | 3.47% | 0.30 | 2023-0040-0028 |
| 2023.11.21(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2023.12.19(화) | 0.30 | 0.94 | 3.48% | 0.30 | 2023-0041-0028 |
| 2023.11.28(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2023.12.26(화) | 0.30 | 0.71 | 3.48% | 0.30 | 2023-0042-0028 |

청약 일정

| 구분 | 청약명 | 업체 | 모집일 | 환불일 | 주간사 / 인수사 (증거금) |
|-----|---------|--------------------|-------------------------------|---------------|--------------------------------|
| 공모주 | LS머트리얼즈 | 울트라커패시터(UC) 제조 기업 | 2023.12.01(금) ~ 2023.12.04(월) | 2023.12.06(수) | 키움, KB / NH, 이베스트, 하이 (5,400억) |
| 공모주 | 블루앤틱 | 의약품 이커머스 기업 | 2023.12.04(월) ~ 2023.12.05(화) | 2023.12.07(목) | 하나, 키움 |
| 실권주 | 누리플랜 | 환경 정화장치 및 조명 제조 기업 | 2023.12.07(목) ~ 2023.12.08(금) | 2023.12.12(화) | SK |
| 실권주 | 아미코젠 | 바이오 및 헬스케어 전문 기업 | 2023.12.07(목) ~ 2023.12.08(금) | 2023.12.12(화) | NH, 한양 |

관련 정보

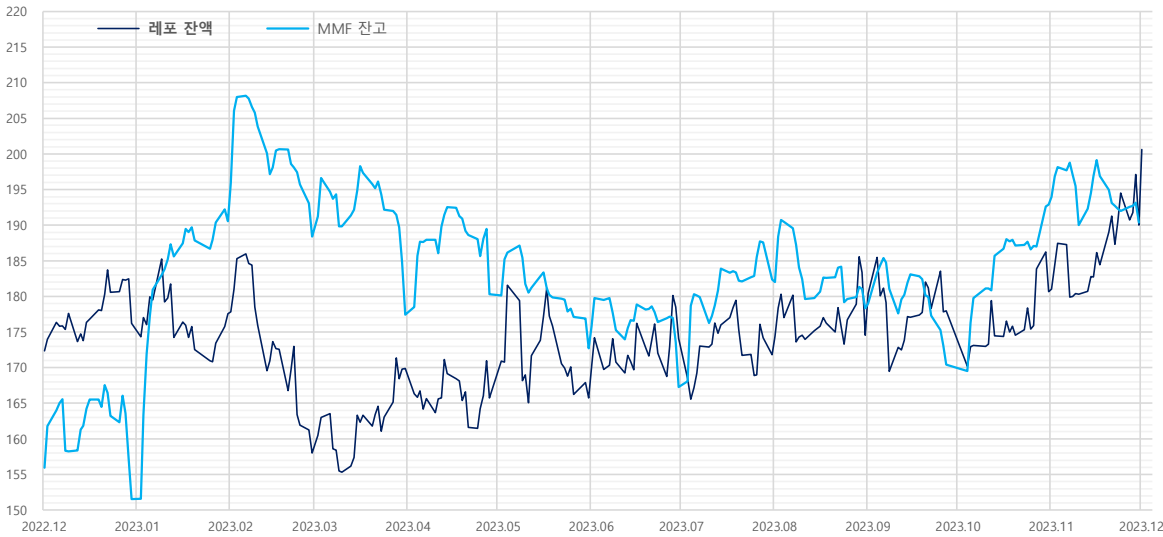
| 지준일 | 2023.12.06(수) | 금통위 | 2024.01.11(목) | FOMC | 2023.12.13(화) ~ 2023.12.14(수) | 한국은행 | http://www.bok.or.kr |
|--|---------------|-----|---------------|------|-------------------------------|---------|---|
| · 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호 | | | | | | 경제통계시스템 | https://ecos.bok.or.kr |
| · 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27) | | | | | | 무위험지표금리 | https://www.kofr.kr |
| · 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판) | | | | | | 증권정보포털 | https://seibro.or.kr |
| · 2024년 지준 계산, 적립기간, 금통위 및 FOMC 예정 일정표 | | | | | | 금융투자협회 | https://kofiafond.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) | | |
| 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 |
| 2023.11.30 | 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

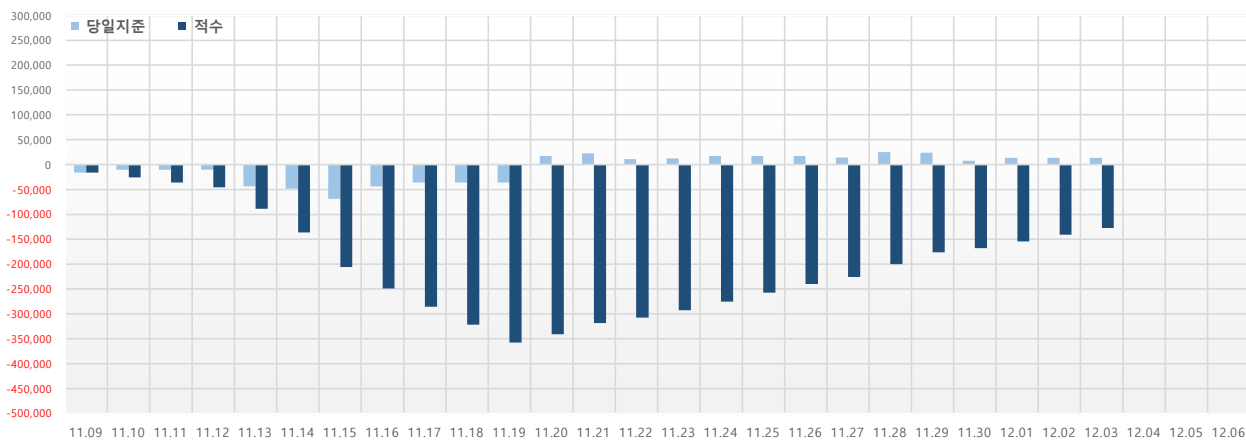


| 기준금리 추이 | | | 단위 : %P |
|----------|---------------|----------|---------------|
| 2023년 | 2022년 | 2021년 | |
| 11.30(목) | 3.50% (동결) | 11.24(목) | 3.25% (▲0.25) |
| 10.19(목) | 3.50% (동결) | 10.12(수) | 3.00% (▲0.50) |
| 08.24(목) | 3.50% (동결) | 08.25(목) | 2.50% (▲0.25) |
| 07.13(목) | 3.50% (동결) | 07.13(수) | 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 |
|----------|---------|----------|
| 11.09(목) | -16,159 | -16,159 |
| 11.10(금) | -9,939 | -25,702 |
| 11.11(토) | -9,939 | -35,641 |
| 11.12(일) | -9,939 | -45,580 |
| 11.13(월) | -43,427 | -89,007 |
| 11.14(화) | -48,059 | -136,432 |
| 11.15(수) | -68,589 | -205,835 |
| 11.16(목) | -43,432 | -248,736 |
| 11.17(금) | -36,258 | -285,179 |
| 11.18(토) | -36,258 | -321,437 |
| 11.19(일) | -36,258 | -357,695 |
| 11.20(월) | 17,063 | -340,999 |
| 11.21(화) | 22,373 | -318,500 |
| 11.22(수) | 11,037 | -307,559 |
| 11.23(목) | 12,174 | -292,484 |
| 11.24(금) | 17,447 | -275,042 |
| 11.25(토) | 17,447 | -257,595 |
| 11.26(일) | 17,447 | -240,148 |
| 11.27(월) | 14,325 | -225,830 |
| 11.28(화) | 25,066 | -200,145 |
| 11.29(수) | 24,072 | -176,072 |
| 11.30(목) | 8,067 | -168,003 |
| 12.01(금) | 13,612 | -154,495 |
| 12.02(토) | 13,612 | -140,883 |
| 12.03(일) | 13,612 | -127,271 |
| 12.04(월) | | |
| 12.05(화) | | |
| 12.06(수) | | |