

레포 시장동향

◎ 지난주

주초 부가세 납부에 따른 자금 이탈에도 불구하고 은행권의 적극적인 매수에 힘입어 수급 무난했으며, 주 중반까지 금리 하락세를 보임.
주 중 대규모 국고여유자금 유입과 공모주(더본코리아) 청약자금 유입되어 시장 유동성 풍부했으며, 기일물 조달금리 하락하였음.
월말세입 공모주 청약 환불 및 MMF 판매 영향으로 조달금리 일시적으로 상승했으나 주말 앞두고 유동성 회복되어 시장 잉여 전환되었음.

◎ 금일

월말세입에 상응하는 국고여유자금 유입되어 시장 잉여세 심화될 것으로 예상됨. 은행권 지준 마감 앞두고 양방향 움직임 흔해질 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2024.11.01 (금)					2024.11.04 (월)				
국고여유자금		7,000			국고여유자금		80,000		
재정 및 기타		29,000			재정 및 기타		8,000		
월말세입 및 기타		-26,000			월말세입 및 기타		-90,000		
전일 기준	지준	-28,840	적수	172,426	금일 예상	지준	-31,000	적수	84,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2024.10.28(월)	219.6	196.8	3.27%	3.277%	3.287%	3.25%	3.41%	2.932%	3.008%
2024.10.29(화)	216.5	196.4	3.23%	3.263%	3.250%		3.41%	2.936%	3.009%
2024.10.30(수)	220.4	197.8	3.20%	3.265%	3.226%		3.43%	2.937%	3.002%
2024.10.31(목)	216.6	193.7	3.26%	3.285%	3.278%		3.43%	2.936%	2.998%
2024.11.01(금)	217.5		3.20%	3.232%	3.222%		3.43%	2.939%	2.995%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2024.10.11(금)	3.25% (▼0.25)	2024.05.23(목)	3.50% (동 결)	2024.01.11(목)	3.50% (동 결)	2023.08.24(목)	3.50% (동 결)	2023.04.11(화)	3.50% (동 결)
2024.08.22(목)	3.50% (동 결)	2024.04.12(금)	3.50% (동 결)	2023.11.30(목)	3.50% (동 결)	2023.07.13(목)	3.50% (동 결)	2023.02.23(목)	3.50% (동 결)
2024.07.11(목)	3.50% (동 결)	2024.02.22(목)	3.50% (동 결)	2023.10.19(목)	3.50% (동 결)	2023.05.25(목)	3.50% (동 결)	2023.01.13(금)	3.50% (▲0.25)

한국은행 공개시장운영 잔액

단위 : 조 원

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰액	금리	낙찰액	낙찰률	회차번호
2024.10.31(목)	14:00~14:10	7	2024.11.07(목)	22.40	3.25%	1.30	5.8%	2024-056-007

◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정액	응찰금액	낙찰금리	낙찰액	회차번호
2024.10.15(화)	14:00~14:10	28	2024.11.12(화)	0.30	0.78	3.20%	0.30	2024-0038-0028
2024.10.22(화)	14:00~14:10	28	2024.11.19(화)	0.30	0.62	3.20%	0.30	2024-0039-0028
2024.10.29(화)	14:00~14:10	28	2024.11.26(화)	0.20	0.52	3.20%	0.20	2024-0040-0028

청약 정보

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사/인수사(증거금)
공모주	노머스	엔터 테크 기업	2024.11.04(월) ~ 2024.11.05(화)	2024.11.07(목)	대신
공모주	닷밀	실감 미디어 전문 기업	2024.11.04(월) ~ 2024.11.05(화)	2024.11.07(목)	미래
공모주	오름테라퓨틱	항암제 개발 기업	2024.11.05(화) ~ 2024.11.06(수)	2024.11.08(금)	한투
공모주	신한스팩15호	기업인수목적회사	2024.11.05(화) ~ 2024.11.06(수)	2024.11.08(금)	신한
공모주	쓰리빌리언	희귀유전질환 진단검사 기업	2024.11.05(화) ~ 2024.11.06(수)	2024.11.08(금)	한투
공모주	하나스팩34호	기업인수목적회사	2024.11.07(목) ~ 2024.11.08(금)	2024.11.12(화)	하나
공모주	에스캠	OLED 소재 기업	2024.11.07(목) ~ 2024.11.08(금)	2024.11.12(화)	NH
공모주	엠오티	2차전지 제조 설비 기업	2024.11.07(목) ~ 2024.11.08(금)	2024.11.12(화)	한투
공모주	위츠	전력전송 솔루션 전문 기업	2024.11.07(목) ~ 2024.11.08(금)	2024.11.12(화)	신한
실권주	롯데리츠	리츠(REITs)	2024.11.07(목) ~ 2024.11.08(금)	2024.11.12(화)	한투, 삼성, KB, 대신
실권주	큐라티스	결핵 백신 개발 기업	2024.11.07(목) ~ 2024.11.08(금)	2024.11.12(화)	상상인
공모주	사이냅소프트	전자문서 소프트웨어 기업	2024.11.08(금) ~ 2024.11.11(월)	2024.11.13(수)	NH

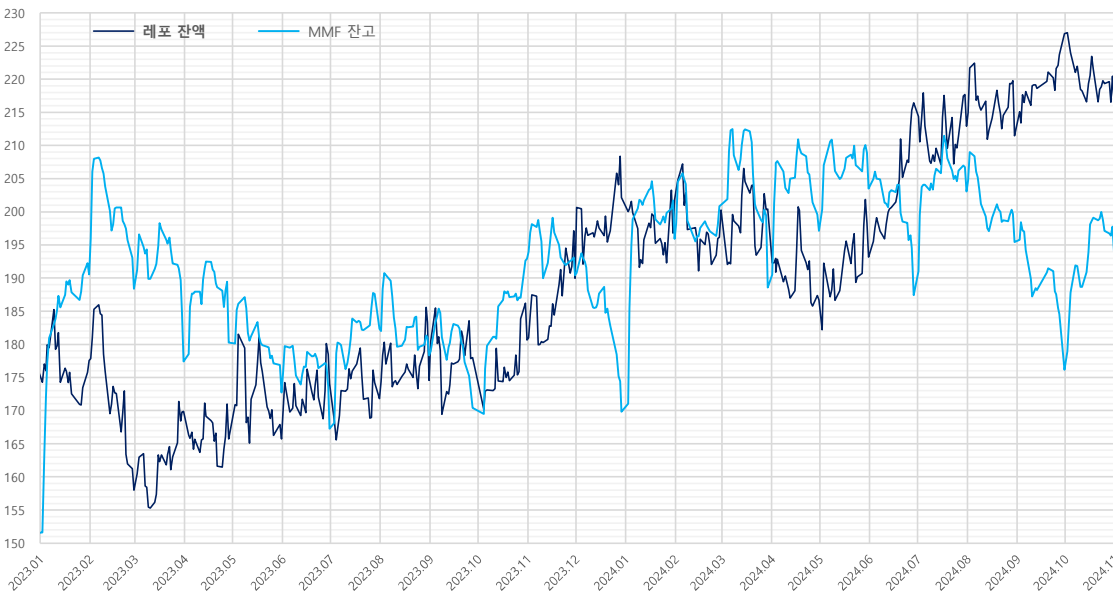
관련 정보

지준일	2024.11.06(수)	금통위	2024.11.28(목)	FOMC	2024.11.06(수) ~ 2024.11.07(목)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24)	www.kcmi.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&zcld=002001016&zno=1792&cno=6356	· 경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr				
· 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlid=10084595&menuNo=200295	· 무위험지표금리	https://www.kofr.kr				
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=10082072&menuNo=200690	· 증권정보포털	https://seibro.or.kr				
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlid=10078655&menuNo=200690	· 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	
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)	03.14(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)	07.11(목)	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)	08.22(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)	06.11(화)		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(금)		
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

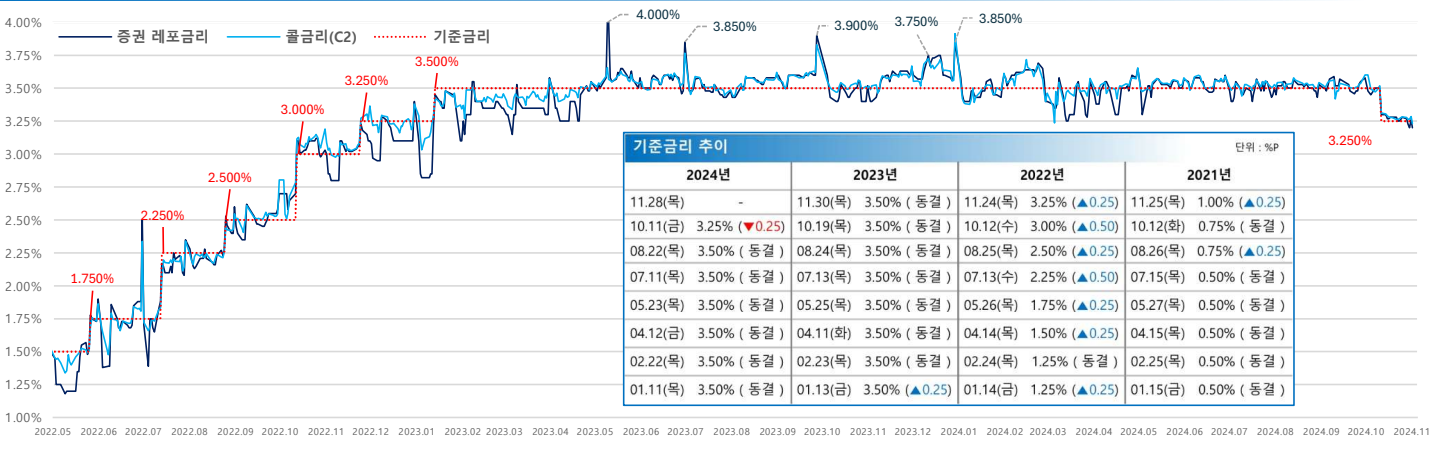


단위 : 조 원

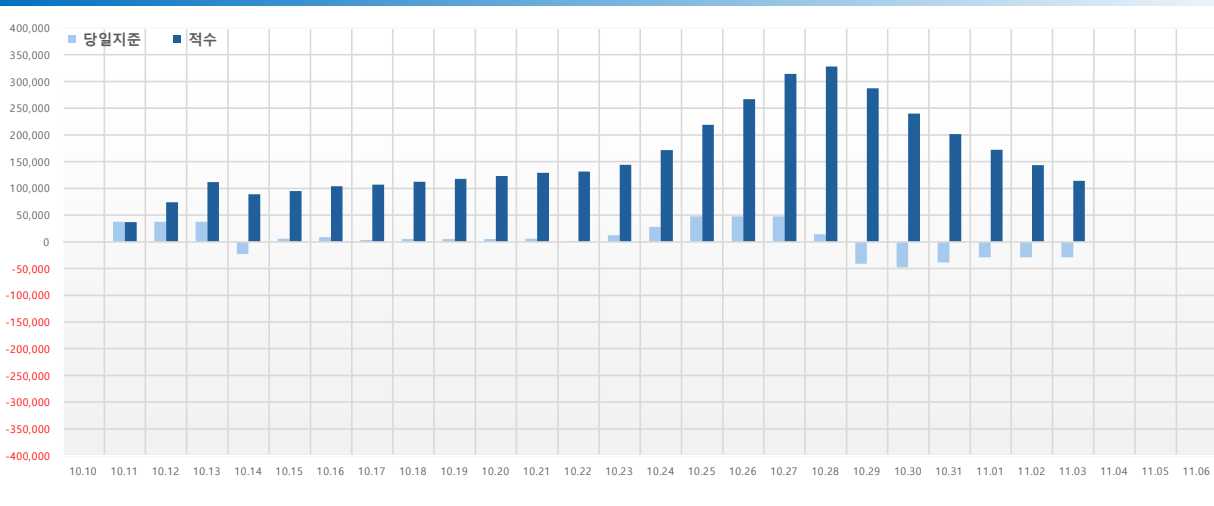
해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	전월대비
2024.09.30	176.2	-8.4	-19.3
2024.08.30	195.4	-4.3	-7.6
2024.07.31	203.1	-3.7	15.6
2024.06.28	187.4	-7.1	-16.1
2024.05.31	203.5	-5.4	6.3
2024.04.30	197.1	-2.4	8.5
2024.03.29	188.6	-10.9	-12.4
2024.02.29	201.0	0.2	5.1
2024.01.31	195.9	-5.8	26.1
2023.12.29	169.8	-4.6	-20.6
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



당일지준 및 적수 추이



단위 : 억 원

날짜	당일지준	적수
10.10(목)	-309	-309
10.11(금)	37,373	37,051
10.12(토)	37,373	74,424
10.13(일)	37,373	111,797
10.14(월)	-22,880	88,890
10.15(화)	6,262	95,151
10.16(수)	8,976	104,129
10.17(목)	3,160	107,302
10.18(금)	5,340	112,643
10.19(토)	5,340	117,983
10.20(일)	5,340	123,323
10.21(월)	6,212	129,539
10.22(화)	1,973	131,507
10.23(수)	12,384	143,891
10.24(목)	27,991	171,883
10.25(금)	47,724	219,334
10.26(토)	47,724	267,058
10.27(일)	47,724	314,782
10.28(월)	13,906	328,148
10.29(화)	-40,501	287,651
10.30(수)	-47,460	240,187
10.31(목)	-38,824	201,370
11.01(금)	-28,840	172,426
11.02(토)	-28,840	143,586
11.03(일)	-28,840	114,746
11.04(월)		
11.05(화)		
11.06(수)		