

## 레포 시장동향

## ◎ 전일

1+1일물 롤오버를 제외한 신규 레포 매도 제한적이었으며, 은행 간 콜 조정 후 지준 소폭 잉여 마감하였음.

## ◎ 금일

연이는 국고여유자금 환수 및 청약 환불 영향으로 유동성 축소되었음. 은행권 매수 의존도 증대되었으며, 금리 수준에 따라 조달여건 가변적일 전망.

## 지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2024.11.06 (수)   |    |         |    | 2024.11.07 (목)           |       |    |         |
|------------------|----|---------|----|--------------------------|-------|----|---------|
| 재정 및 기타 [근금여1.0] |    | 28,000  |    | 한은RP매각 만기(7일)            |       |    | 13,000  |
|                  |    |         |    | 재정 및 기타                  |       |    | 45,000  |
| 국고여유자금 환수        |    | -8,000  |    | 한은RP매각(7일)               |       |    | -5,000  |
| 세입 및 기타          |    | -35,000 |    | 통안채 발행(2년), 낙찰수익률 2.970% |       |    | -19,100 |
|                  |    |         |    | 국고여유자금 환수                |       |    | -21,000 |
|                  |    |         |    | 세입 및 기타                  |       |    | -10,000 |
|                  |    |         |    | 요지준 변동                   |       |    | -4,000  |
| 전일 기준            | 지준 | -46,889 | 적수 | 1,152                    | 금일 예상 | 지준 | -48,000 |
|                  |    |         |    |                          |       | 적수 | -48,000 |

## Market Data

단위 : 조 원

|               | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리  | 콜금리(C2) | KOFR   | 기준금리  | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|-------|---------|---------|---------|
| 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   | 194.2  | 3.20% | 3.232%  | 3.222% |       | 3.43%   | 2.939%  | 2.995%  |
| 2024.11.04(월) | 221.9   | 198.1  | 3.15% | 3.228%  | 3.175% | 3.25% | 3.43%   | 2.935%  | 2.994%  |
| 2024.11.05(화) | 214.4   | 200.6  | 3.23% | 3.192%  | 3.260% |       | 3.44%   | 2.918%  | 2.971%  |
| 2024.11.06(수) | 214.7   |        | 3.23% | 3.236%  | 3.259% |       | 3.44%   | 2.960%  | 3.023%  |

## 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 |

## ◎ 통화안정예정예치금

| 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(112억)       |
| 공모주 | 닷밀      | 실감 미디어 전문 기업   | 2024.11.04(월) ~ 2024.11.05(화) | 2024.11.07(목) | 미래(1,139억)     |
| 공모주 | 신한스팩15호 | 기업인수목적회사       | 2024.11.05(화) ~ 2024.11.06(수) | 2024.11.08(금) | 신한(1.09조)      |
| 공모주 | 쓰리빌리언   | 희귀유전질환 진단검사 기업 | 2024.11.05(화) ~ 2024.11.06(수) | 2024.11.08(금) | 한투(420억)       |
| 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 | 위즈      | 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             |

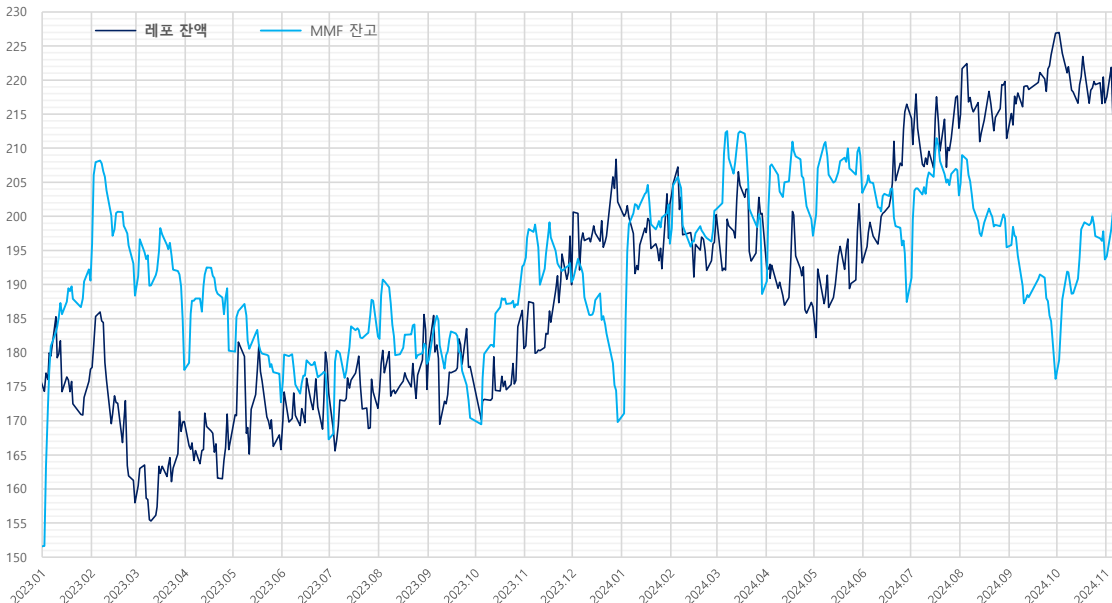
## 관련 정보

| 지준일   | 2024.12.11(수)  | 금통위       | 2024.11.28(목)   | FOMC | 2024.11.06(수) ~ 2024.11.07(목) | 한국은행 | <a href="http://www.bok.or.kr">http://www.bok.or.kr</a> |
|---|--|-----------|---|------|-------------------------------|------|---|
| · 자본시장연구원, 포스트 LIBOR 시대의 글로벌 지표금리 체제와 국내 시사점 (2024.06.24) | <a href="http://www.kcmi.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&amp;zcd=0020010168&amp;zno=1792&amp;cno=6356">www.kcmi.re.kr/publications/pub_detail_view?year=2024&amp;zcd=0020010168&amp;zno=1792&amp;cno=6356</a> | · 경제통계시스템 | <a href="https://ecos.bok.or.kr">https://ecos.bok.or.kr</a>   |      |                               |      |   |
| · 한국은행, 2024년 공개시장운영 대상기관 선정 관련 안내 (2024.06.11)           | <a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttld=10084595&amp;menuNo=200295">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttld=10084595&amp;menuNo=200295</a>   | · 무위험지표금리 | <a href="https://www.kofr.kr">https://www.kofr.kr</a>         |      |                               |      |   |
| · 한국은행, 공개시장운영 대상기관 확대 및 제도 개선 (2024.01.25)               | <a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10082072&amp;menuNo=200690">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10082072&amp;menuNo=200690</a>   | · 증권정보포털  | <a href="https://seibro.or.kr">https://seibro.or.kr</a>       |      |                               |      |   |
| · 한국은행, 대출제도 개선 방향 (2023.07.27)                           | <a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10078655&amp;menuNo=200690">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10078655&amp;menuNo=200690</a>   | · 금융투자협회  | <a href="https://kofiabond.or.kr">https://kofiabond.or.kr</a> |      |                               |      |   |

기준 계산-적립기간, 금통위 및 FOMC

|           | 기준 계산기간  |          | 기준 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) | 03.28(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

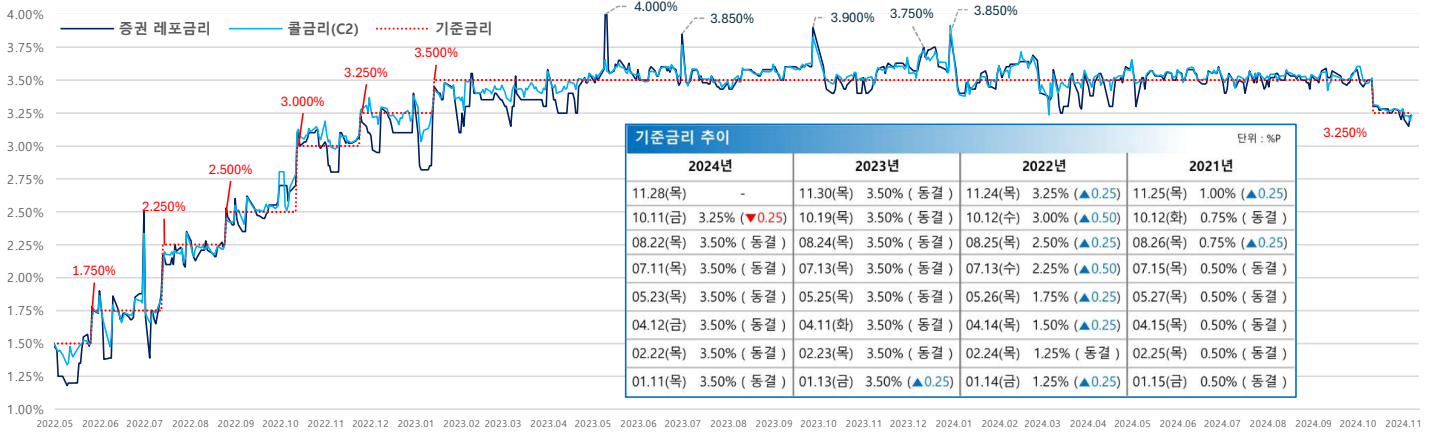


단위 : 조 원

| 월          | MMF   | 전월대비  | 전월대비  |
|------------|-------|-------|-------|
| 2024.10.31 | 193.7 | -4.1  | 17.5  |
| 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, 메커칼계좌

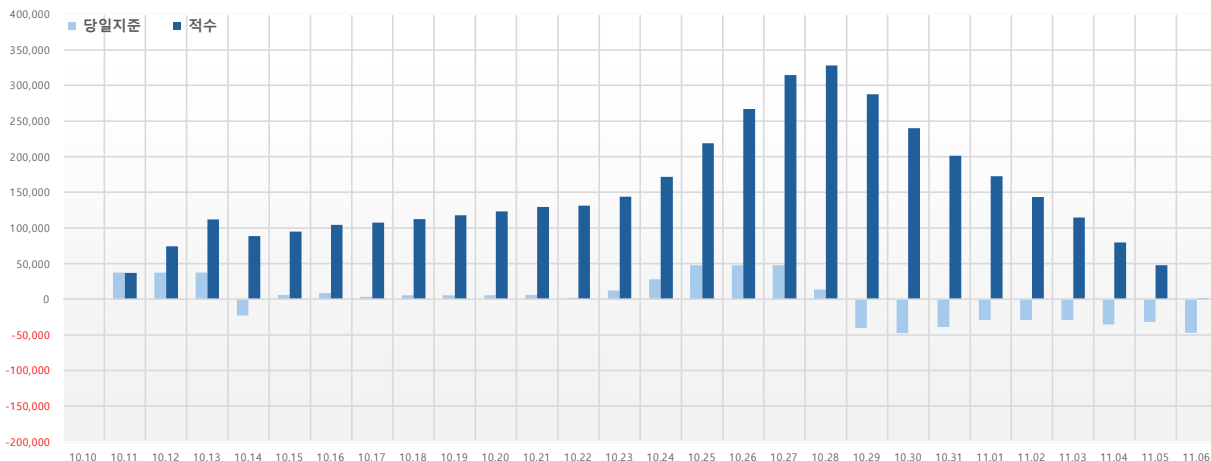
단기금융시장 금리 추이



| 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(수) 1.00% (▲0.25) |
| 10.11(금) | 3.25% (▼0.25) | 10.19(목) 3.50% (동결)    | 10.12(수) 3.00% (▲0.50) | 10.12(화) 0.75% (동결)    |
| 08.22(목) | 3.50% (동결)    | 08.24(목) 3.50% (동결)    | 08.25(목) 2.50% (▲0.25) | 08.26(목) 0.75% (▲0.25) |
| 07.11(목) | 3.50% (동결)    | 07.13(목) 3.50% (동결)    | 07.13(수) 2.25% (▲0.50) | 07.15(목) 0.50% (동결)    |
| 05.23(목) | 3.50% (동결)    | 05.25(목) 3.50% (동결)    | 05.26(목) 1.75% (▲0.25) | 05.27(목) 0.50% (동결)    |
| 04.12(금) | 3.50% (동결)    | 04.11(화) 3.50% (동결)    | 04.14(목) 1.50% (▲0.25) | 04.15(목) 0.50% (동결)    |
| 02.22(목) | 3.50% (동결)    | 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

당일기준 및 적수 추이



단위 : 억 원

| 날짜       | 당일기준    | 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) | -35,123 | 79,668  |
| 11.05(화) | -31,832 | 47,841  |
| 11.06(수) | -46,889 | 1,152   |