

레포 시장동향

◎ 전일

건보자금 유효하여 잉여세 지속된 가운데 장중 체결금리 하락하였음. 금통위 앞두고 있음에도 기일을 조달 원활했으며, 수급 매우 양호한 모습을 보임.

◎ 금일

공모(워드) 및 실권주 청약자금 운용으로 유동성 매우 풍부하겠으며, 시장 잉여세 반영하여 은행 및 증권 저금리 매도 수요 증가할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.10.17 (화)				2023.10.18 (수)			
통안계정 만기(28일)		5,000		재정 [국세환급0.1 실시간0.7]			8,000
통안채 만기(91일)		15,300		자금조정예금 만기			8,000
공자기금		19,000					
재정 [국세환급0.1 실시간1.3]		14,000					
자금조정예금 만기		5,000					
기타		2,000					
통안계정(28일)		-5,000		국고여유자금 환수			-13,000
통안채 발행(91일), 낙찰수익률 3.620% 낙찰할인율 3.588%		-10,000		세입			-12,000
국고채 발행(10년)		-15,000		자금조정예금			-5,000
국고여유자금 환수		-3,000					
세입		-14,000					
자금조정예금		-8,000					
전일 기준	지준	27,654	적수	114,999	금일 예상	지준	14,000
						적수	129,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.10.11(수)	173.3	181.1	3.40%	3.473%	3.467%	3.500%	3.82%	3.953%	4.039%
2023.10.12(목)	179.4	180.8	3.43%	3.512%	3.460%		3.82%	3.932%	4.004%
2023.10.13(금)	174.5	185.7	3.53%	3.542%	3.551%		3.82%	3.957%	4.036%
2023.10.16(월)	174.4	186.7	3.48%	3.518%	3.506%		3.82%	3.973%	4.064%
2023.10.17(화)	176.5		3.46%	3.493%	3.490%		3.82%	3.991%	4.092%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

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)
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)	2022.01.14(금) 1.25% (▲0.25)
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)	2021.11.25(목) 1.00% (▲0.25)

한국은행 공개시장운영 잔액

◎ RP매각

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.10.12(목)	14:00~14:10	7	2023.10.19(목)	64.20	3.50%	1.00	1.6%	2023-054-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2023.09.26(화)	14:00~14:10	28	2023.10.24(화)	0.50	0.65	3.55%	0.50	2023-0034-0028
2023.10.04(수)	14:00~14:10	27	2023.10.31(화)	0.50	0.78	3.53%	0.50	2023-0035-0027
2023.10.17(화)	14:00~14:10	27	2023.11.14(화)	0.50	1.72	3.47%	0.50	2023-0037-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	워드	반도체 공정환경제어 장비 기업	2023.10.16(월) ~ 2023.10.17(화)	2023.10.19(목)	키움 (5.79조)
실권주	피플바이오	바이오 제품 개발 기업	2023.10.16(월) ~ 2023.10.17(화)	2023.10.19(목)	한투 (5,000억)
실권주	레몬	나노소재 전문 기업	2023.10.16(월) ~ 2023.10.17(화)	2023.10.19(목)	현대차 (779억)
공모주	켈리타스반도체	반도체 설계자산(IP) 전문 기업	2023.10.18(수) ~ 2023.10.19(목)	2023.10.23(월)	한투

관련 정보

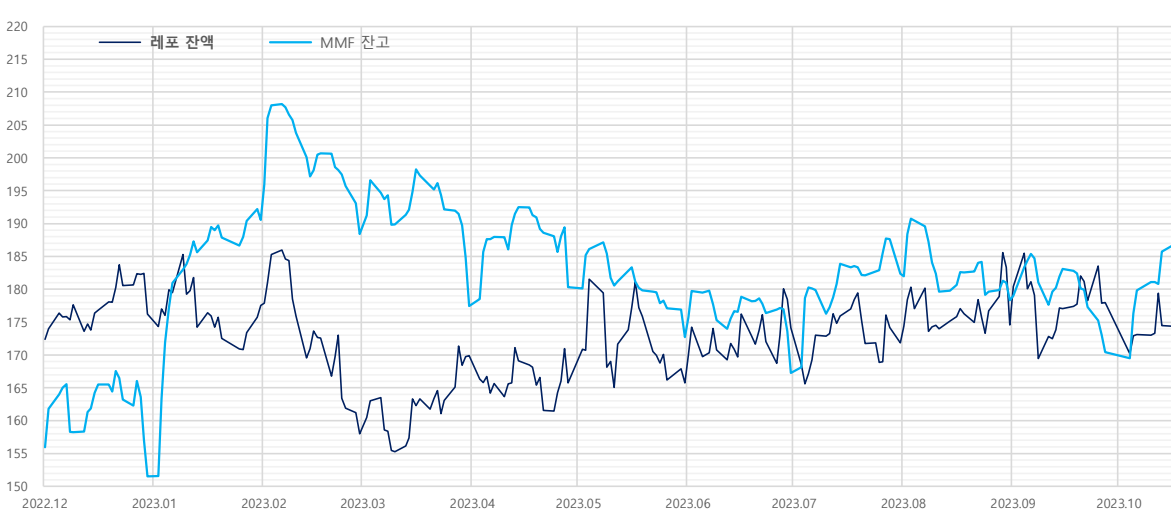
지준일 2023.11.08(수)	금통위 2023.10.19(목)	FOMC 2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수)	한국은행 http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호			경제통계시스템 https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttId=10078655&menuNo=200690		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
· 2023년 지준 계산·적립기간 및 금통위	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttId=10074187&menuNo=200295		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 1월	01.01(일)	01.31(화)	02.09(목)	03.08(수)	01.13(금)	01.26(목)		01.31(화) ~ 02.01(수)
2023년 2월	02.01(수)	02.28(화)	03.09(목)	04.05(수)	02.23(목)	02.09(목)		
2023년 3월	03.01(수)	03.31(금)	04.06(목)	05.10(수)		03.09(목)	03.23(목)	03.21(화) ~ 03.22(수)
2023년 4월	04.01(토)	04.30(일)	05.11(목)	06.07(수)	04.11(화)	04.27(목)		
2023년 5월	05.01(월)	05.31(수)	06.08(목)	07.05(수)	05.25(목)	05.11(목)		05.02(화) ~ 05.03(수)
2023년 6월	06.01(목)	06.30(금)	07.06(목)	08.09(수)		06.08(목)	06.21(수)	
2023년 7월	07.01(토)	07.31(월)	08.10(목)	09.06(수)	07.13(목)	09.25(월)		06.13(화) ~ 06.14(수)
2023년 8월	08.01(화)	08.31(목)	09.07(목)	10.11(수)	08.24(목)	08.10(목)		
2023년 9월	09.01(금)	09.30(토)	10.12(목)	11.08(수)		07.28(금)	09.26(화)	09.19(화) ~ 09.20(수)
2023년 10월	10.01(일)	10.31(화)	11.09(목)	12.06(수)	10.19(목)	10.26(목)		
2023년 11월	11.01(수)	11.30(목)	12.07(목)	2024.01.10(수)	11.30(목)	11.09(목)		10.31(화) ~ 11.01(수)
2023년 12월	12.01(금)	12.31(일)	2024.01.11(목)	2024.02.07(수)		12.14(목)	12.28(목)	

레포 거래잔액 및 MMF 잔고 추이

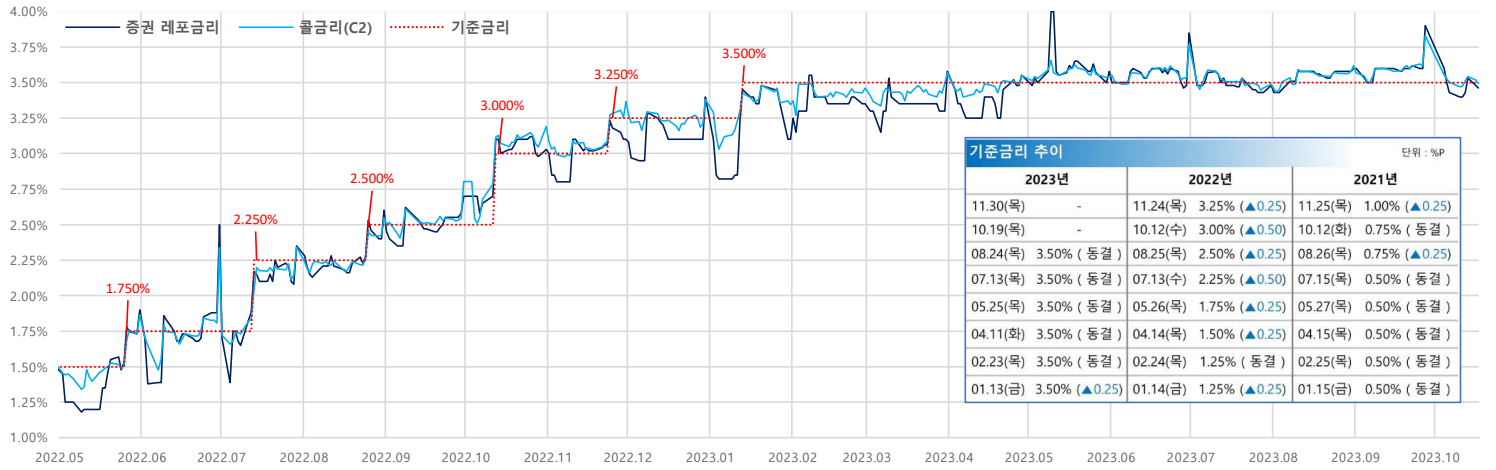
단위 : 조 원



해당연월	월말 MMF 증감내역		
	MMF	전월대비	전월대비
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

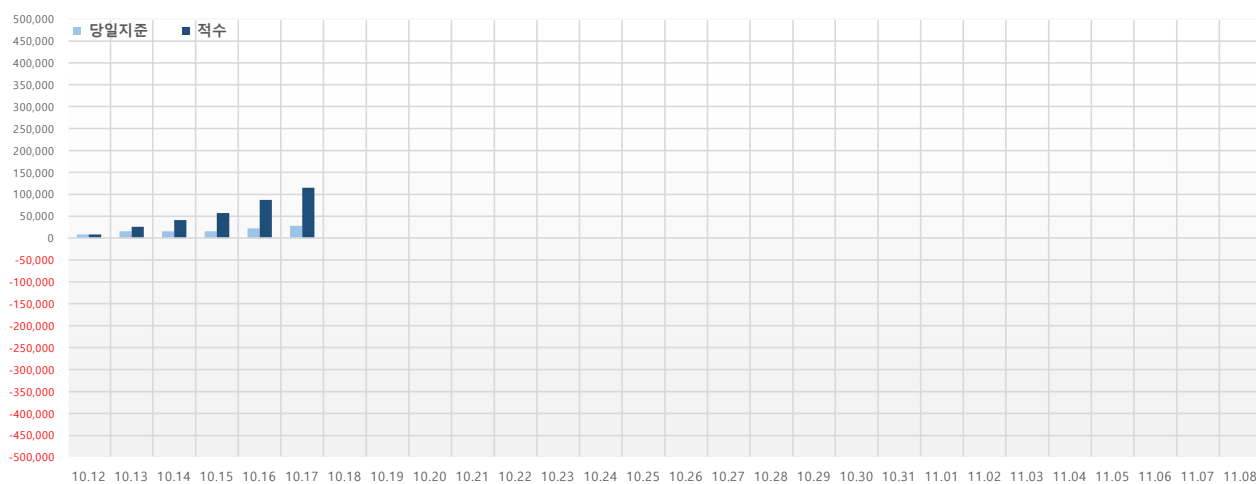


기준금리 추이			단위 : %P
2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	1.75% (▲0.25)
04.11(화)	3.50% (동결)	04.14(목)	1.50% (▲0.25)
02.23(목)	3.50% (동결)	02.24(목)	1.25% (동결)
01.13(금)	3.50% (▲0.25)	01.14(금)	1.25% (▲0.25)
		01.15(금)	0.50% (동결)
		07.15(목)	0.50% (동결)
		08.26(목)	0.75% (▲0.25)
		10.12(화)	0.75% (동결)
		11.25(목)	1.00% (▲0.25)

자료 : 한국은행

당일지준 및 적수 추이

단위 : 억 원



	당일지준	적수
10.12(목)	7,733	7,733
10.13(금)	15,488	25,952
10.14(토)	15,488	41,440
10.15(일)	15,488	56,928
10.16(월)	22,152	87,364
10.17(화)	27,654	114,999
10.18(수)		
10.19(목)		
10.20(금)		
10.21(토)		
10.22(일)		
10.23(월)		
10.24(화)		
10.25(수)		
10.26(목)		
10.27(금)		
10.28(토)		
10.29(일)		
10.30(월)		
10.31(화)		
11.01(수)		
11.02(목)		
11.03(금)		
11.04(토)		
11.05(일)		
11.06(월)		
11.07(화)		
11.08(수)		