

레포 시장동향

- ◎ 전주
주초 공모주 청약(퀵리타스반도체) 환불 영향으로 유동성 축소됐으나 조달금리 부담으로 은행권 매도 감소하여 수급 대체로 무난하였음. 부가세 납부에 앞서 국고여유자금 환수 선행되어 조달금리 추가 상승했으며, 일시적인 부족세 형성되어 은행권 매수 의존도 증대되었음. 주말 전 국고 및 재정 유입 상당하여 매수 자금 크게 증가했으며, 레포금리 콜금리를 하회함에 따라 은행권 매도에 적극적인 모습을 보임.

- ◎ 금일
시장 유동성 및 적수 흐름 양호하여 전일에 이어 조달여건 매우 좋겠으며, 은행권 움직임에 따라 잉여 수준 결정되었음.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.10.27 (금)				2023.10.30 (월)					
국고여유자금		154,000		재정 [국세환급0.2 실시간0.8]			10,000		
제기금		2,000		자금조정예금 만기			4,000		
재정 [복지부2.2 국세환급0.1 실시간0.5]		28,000							
자금조정예금 만기		4,000							
공자기금 환수		-7,000		공자기금 환수			-2,000		
부가세 본납		-180,000		국고채 비경쟁인수			-2,000		
자금조정예금		-4,000		세입			-7,000		
기타		-3,000		자금조정예금			-4,000		
전일 기준	지준	24,505	적수	316,831	금일 예상	지준	23,000	적수	389,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.10.23(월)	175.3	187.2	3.50%	3.538%	3.526%		3.82%	4.055%	4.225%
2023.10.24(화)	178.4	187.6	3.50%	3.531%	3.525%		3.82%	4.004%	4.140%
2023.10.25(수)	175.4	186.6	3.55%	3.561%	3.569%	3.500%	3.82%	4.038%	4.157%
2023.10.26(목)	175.9	187.1	3.55%	3.556%	3.570%		3.82%	4.104%	4.237%
2023.10.27(금)	183.8		3.40%	3.494%	3.440%		3.82%	4.073%	4.170%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

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)
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)

한국은행 공개시장운영 잔액

◎ RP매각

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.10.26(목)	14:00~14:10	7	2023.11.02(목)	30.20	3.50%	1.00	3.3%	2023-056-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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	28	2023.11.14(화)	0.50	1.72	3.47%	0.50	2023-0037-0028
2023.10.24(화)	14:00~14:10	28	2023.11.21(화)	0.50	1.32	3.48%	0.50	2023-0038-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	쏘닉스	무선통신필터 파운드리 전문 기업	2023.10.26(목) ~ 2023.10.27(금)	2023.10.31(화)	KB (2.6조)
공모주	메가터치	2차전지 및 반도체 장비 기업	2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수)	2023.11.03(금)	NH
공모주	비아이메트릭스	로우코드 솔루션 전문 기업	2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수)	2023.11.03(금)	IBK
공모주	큐로셀	항암세포 치료제 개발 기업	2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수)	2023.11.03(금)	미래, 삼성
공모주	컨텍	전기 통신 전문 기업	2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수)	2023.11.03(금)	대신
공모주	에스와이스틸텍	테크플레이트 제조 및 설치 기업	2023.11.01(수) ~ 2023.11.02(목)	2023.11.06(월)	KB
공모주	한국제13호스팩	기업인수목적회사	2023.11.01(수) ~ 2023.11.02(목)	2023.11.06(월)	한투
공모주	에이직랜드	주문형반도체 설계 전문 기업	2023.11.02(목) ~ 2023.11.03(금)	2023.11.07(화)	삼성
실권주	강스템바이오텍	줄기세포 치료제 연구개발 기업	2023.11.02(목) ~ 2023.11.03(금)	2023.11.07(화)	한양
실권주	메디포스트	줄기세포 치료제 연구개발 기업	2023.11.03(금) ~ 2023.11.06(월)	2023.11.08(수)	NH
실권주	원익피앤이	배터리 후공정 장비 기업	2023.11.03(금) ~ 2023.11.06(월)	2023.11.08(수)	한투, 교보

관련 정보

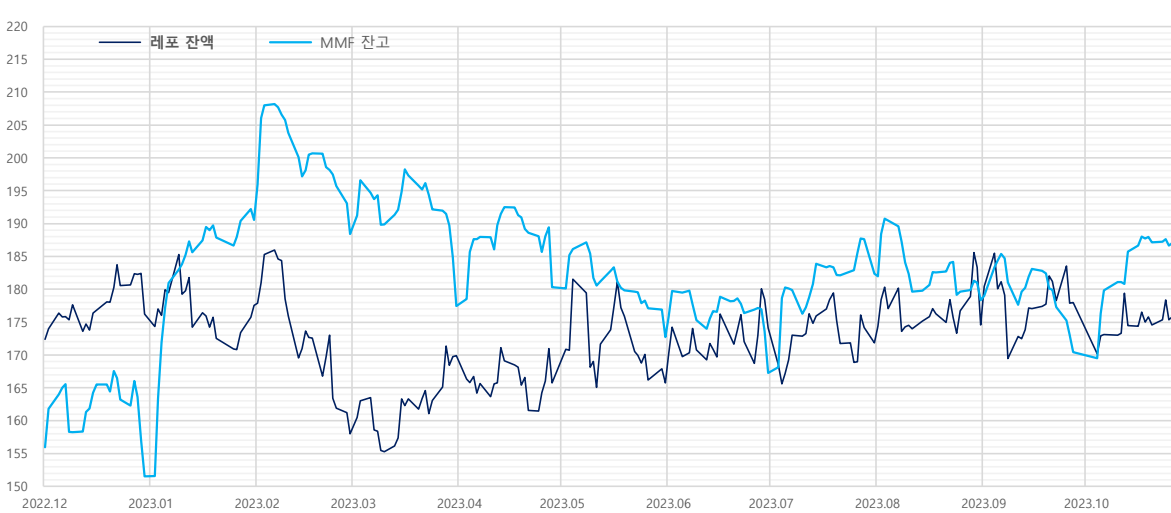
지준일	2023.11.08(수)	금통위	2023.11.30(목)	FOMC	2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr	
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr	
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10078655&menuNo=200690	무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttld=10068266&menuNo=200460	증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 2024년 금융통화위원회 정기회의 개최 및 의사록 공개 예정일정						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10080147&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	
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

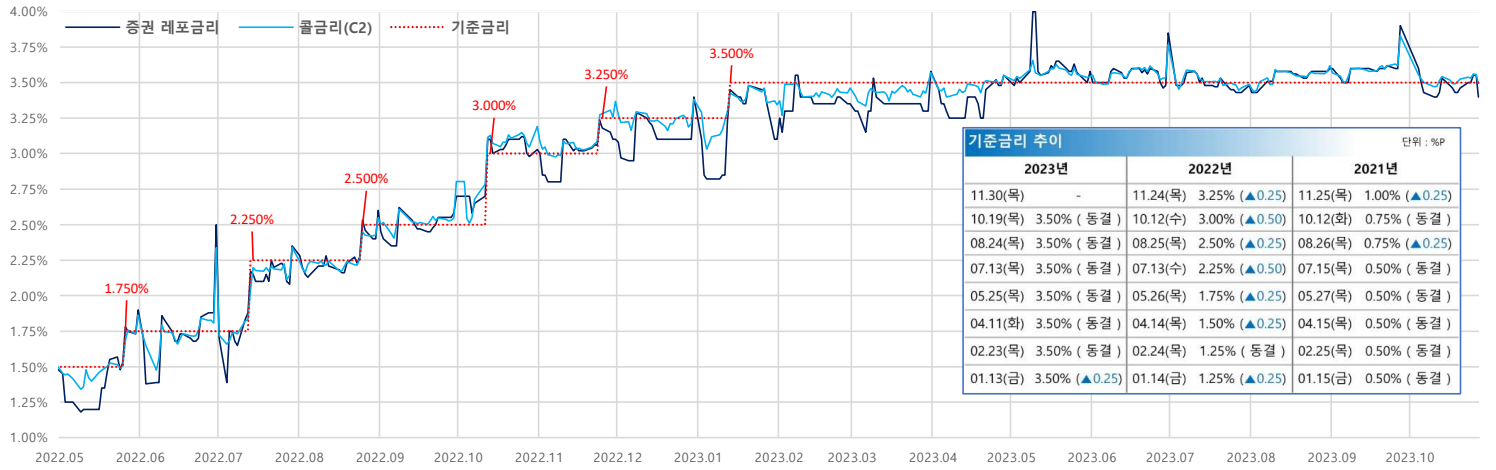
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	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

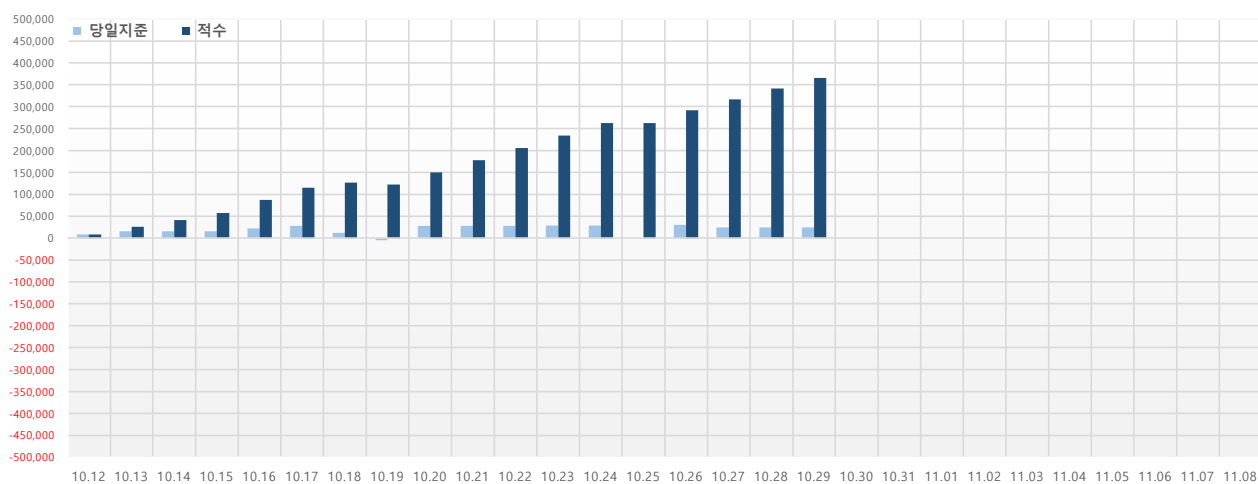


기준금리 추이			단위 : %P		
2023년	2022년	2021년	2023년	2022년	2021년
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25%	3.25%	1.00%
10.19(목)	3.50%	10.12(수)	3.00%	3.00%	0.75%
08.24(목)	3.50%	08.25(목)	2.50%	2.50%	0.75%
07.13(목)	3.50%	07.13(수)	2.25%	2.25%	0.50%
05.25(목)	3.50%	05.26(목)	1.75%	1.75%	0.50%
04.11(화)	3.50%	04.14(목)	1.50%	1.50%	0.50%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

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)	11,917	126,906
10.19(목)	-4,865	122,044
10.20(금)	27,776	149,821
10.21(토)	27,776	177,597
10.22(일)	27,776	205,373
10.23(월)	29,263	234,035
10.24(화)	28,864	262,888
10.25(수)	-550	262,318
10.26(목)	30,008	292,324
10.27(금)	24,505	316,831
10.28(토)	24,505	341,336
10.29(일)	24,505	365,841
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)		