

레포 시장동향

◎ 전주

월말일 공모주 청약 환불, 국고여유자금 환수 등 자금 이탈 요인 많아 조달금리 일시적으로 급등했으나 은행권 매수 증가하여 수급 무난하였음.
 월초 유동성 회복됨에 따라 조달여건 차츰 호전되었으며, 월말세입에 상응하는 국고 유입과 청약자금 운용에 힘입어 금리 하락세 전환되었음.
 레포금리 콜차입 금리를 하회하여 시은 매도에 적극적이었으나 운용금리 낮았던 탓에 추가 자금 많지 않아 주 후반부 타이트한 모습을 보이기도 함.

◎ 금일

국고여유자금 환수 이어지나 공모주 청약자금 유입되어 조달여건 양호할 것으로 기대됨. 지준 마감 앞두고 시은 조달 제한적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.11.03 (금)				2023.11.06 (월)			
재정 [국세환급1.2 실시간0.3]		15,000		국고채 조기상환			20,000
자금조정예금 만기		5,000		재정 [국세환급1.1 실시간0.4]			15,000
				자금조정예금 만기			6,000
공자기금 환수		-14,000		국고여유자금 환수			-9,000
국고여유자금 환수		-12,000		세입			-6,000
국고채 비경쟁인수		-5,000		자금조정예금			-4,000
세입		-4,000					
자금조정예금		-6,000					
전일 지준	지준	-70,168	적수	296,184	금일 예상	지준	-48,000
						적수	107,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.10.30(월)	186.2	192.6	3.40%	3.515%	3.443%		3.82%	4.089%	4.201%
2023.10.31(화)	180.6	192.9	3.52%	3.500%	3.544%		3.82%	4.085%	4.203%
2023.11.01(수)	181.0	194.0	3.45%	3.516%	3.482%	3.500%	3.83%	4.071%	4.173%
2023.11.02(목)	184.4	196.9	3.40%	3.490%	3.437%		3.83%	3.979%	4.070%
2023.11.03(금)	187.4		3.40%	3.520%	3.437%		3.83%	3.949%	4.021%

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
2023.11.02(목)	14:00~14:10	7	2023.11.09(목)	39.95	3.50%	3.00	7.5%	2023-057-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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
2023.10.31(화)	14:00~14:10	28	2023.11.28(화)	0.70	1.07	3.50%	0.84	2023-0039-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	에스와이스틸텍	테크플레이트 제조 및 설치 기업	2023.11.01(수) ~ 2023.11.02(목)	2023.11.06(월)	KB(1.58조)
공모주	한국제13호스팩	기업인수목적회사	2023.11.01(수) ~ 2023.11.02(목)	2023.11.06(월)	한투(2,780억)
공모주	에이직랜드	주문형반도체 설계 전문 기업	2023.11.02(목) ~ 2023.11.03(금)	2023.11.07(화)	삼성(6.26조)
실권주	강스탬바이오텍	줄기세포 치료제 연구개발 기업	2023.11.02(목) ~ 2023.11.03(금)	2023.11.07(화)	한양(106억)
실권주	원익피앤이	배터리 후공정 장비 기업	2023.11.03(금) ~ 2023.11.06(월)	2023.11.08(수)	한투, 교보(8억)
공모주	캡스톤파트너스	벤처캐피탈(VC)	2023.11.06(월) ~ 2023.11.07(화)	2023.11.09(목)	NH
실권주	박셀바이오	항암면역세포치료제 개발 기업	2023.11.06(월) ~ 2023.11.07(화)	2023.11.09(목)	한투
실권주	루닛	의료 인공지능(AI) 기업	2023.11.06(월) ~ 2023.11.07(화)	2023.11.09(목)	NH
공모주	에코프로머티리얼즈	2차전지 관련 전구체 생산 기업	2023.11.08(수) ~ 2023.11.09(목)	2023.11.13(월)	미래, NH / 하이
공모주	스토텍	정수기 부품 제조 기업	2023.11.09(목) ~ 2023.11.10(금)	2023.11.14(화)	하이
공모주	동인기연	아웃도어 브랜드 OEM-ODM 기업	2023.11.09(목) ~ 2023.11.10(금)	2023.11.14(화)	NH
실권주	코스모신소재	2차전지용 양극활물질 생산 기업	2023.11.09(목) ~ 2023.11.10(금)	2023.11.14(화)	KB, NH, 하나
실권주	미코바이오메드	체외진단의료기기 제조 기업	2023.11.09(목) ~ 2023.11.10(금)	2023.11.14(화)	KB
실권주	에코플라스틱	자동차 부품 전문 기업	2023.11.09(목) ~ 2023.11.10(금)	2023.11.14(화)	KB, 신한
공모주	에코아이	탄소배출권 전문 기업	2023.11.10(금) ~ 2023.11.13(월)	2023.11.15(수)	KB

관련 정보

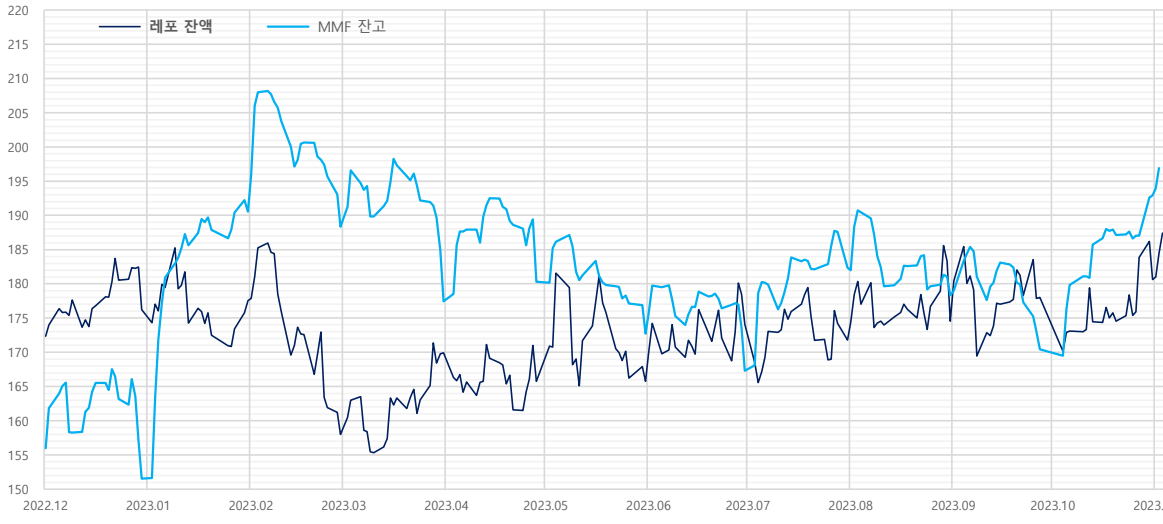
지준일	2023.11.08(수)	금통위	2023.11.30(목)	FOMC	2023.12.13(화) ~ 2023.12.14(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10078655&menuNo=200690		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
· 2024년 금융통화위원회 정기회의 개최 및 의사록 공개 예정일정				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=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)	06.13(화) ~ 06.14(수)
2023년 7월	07.01(토)	07.31(월)	08.10(목)	09.06(수)	07.13(목)	09.25(월)		07.25(화) ~ 07.26(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)		10.31(화) ~ 11.01(수)
2023년 11월	11.01(수)	11.30(목)	12.07(목)	2024.01.10(수)	11.30(목)	11.09(목)		
2023년 12월	12.01(금)	12.31(일)	2024.01.11(목)	2024.02.07(수)		12.14(목)	12.28(목)	12.12(화) ~ 12.13(수)

레포 거래잔액 및 MMF 잔고 추이

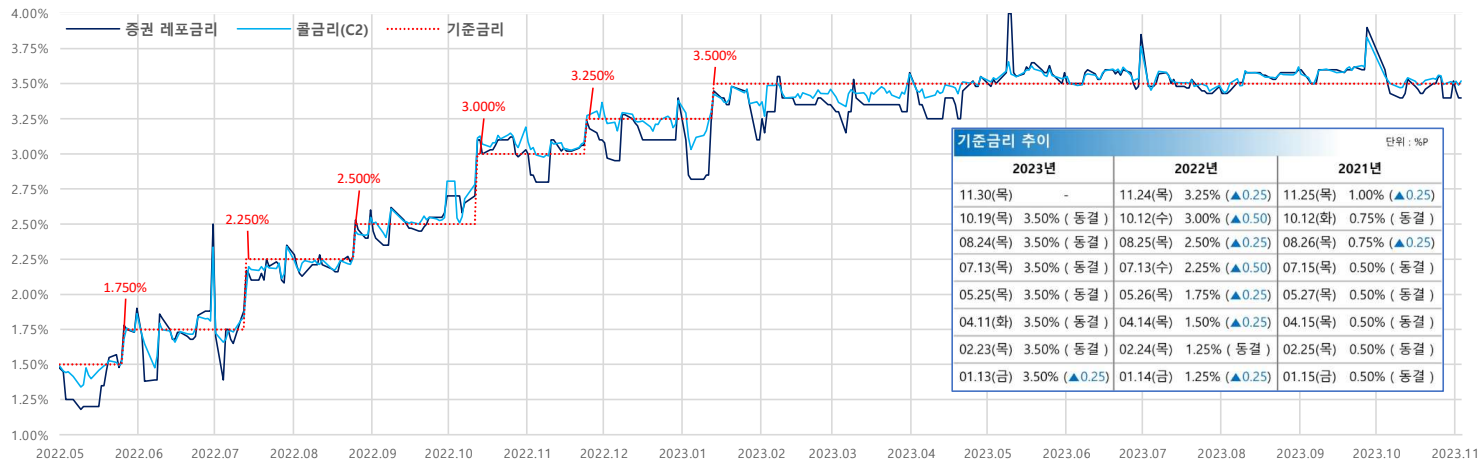
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	전월대비
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	3.6	22.5

자료 : 금융투자협회, 예탁결제원

단기금융시장 금리 추이

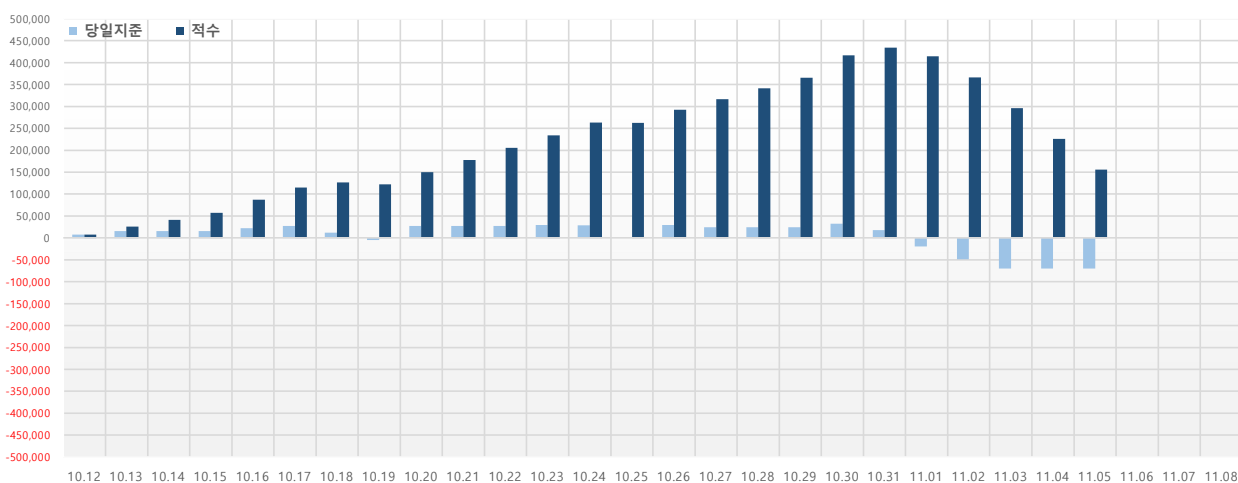


기준금리 추이			단위 : %P					
2023년	2022년	2021년						
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25%	(▲0.25)	11.25(목)	1.00%	(▲0.25)	
10.19(목)	3.50%	(동결)	10.12(수)	3.00%	(▲0.50)	10.12(화)	0.75%	(동결)
08.24(목)	3.50%	(동결)	08.25(목)	2.50%	(▲0.25)	08.26(목)	0.75%	(▲0.25)
07.13(목)	3.50%	(동결)	07.13(수)	2.25%	(▲0.50)	07.15(목)	0.50%	(동결)
05.25(목)	3.50%	(동결)	05.26(목)	1.75%	(▲0.25)	05.27(목)	0.50%	(동결)
04.11(화)	3.50%	(동결)	04.14(목)	1.50%	(▲0.25)	04.15(목)	0.50%	(동결)
02.23(목)	3.50%	(동결)	02.24(목)	1.25%	(동결)	02.25(목)	0.50%	(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
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)	32,912	416,761
10.31(화)	17,610	434,568
11.01(수)	-19,617	414,874
11.02(목)	-48,517	366,355
11.03(금)	-70,168	296,184
11.04(토)	-70,168	226,016
11.05(일)	-70,168	155,848
11.06(월)		
11.07(화)		
11.08(수)		