

레포 시장동향

◎ 전일

국고금 및 재정 유입 규모 상당했으나 원천세 본납과 청약 환불 영향으로 금리 보합 출발하였음. 장 초반부터 은행권 매수 충분하여 수급 무난한 모습을 보임.

◎ 금일

건보 및 청약자금 운용 기대되는 가운데 국고금 환수에도 조달여건 양호할 전망. 레포금리 수준에 따라 은행권 양방향 움직임 가변적이겠음.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.11.14 (화)				2023.11.15 (수)					
통안계정 만기(28일)		5,000		재정 [복지부0.9 국세환급0.1 실시간0.5]			15,000		
공자기금		6,000		자금조정예금 만기			4,000		
국고여유자금		28,000							
제기금		1,000							
재정 [교육부4.1 국세환급0.2 실시간0.8]		51,000							
자금조정예금 만기		3,000							
통안계정(28일)		-3,000	국고여유자금 환수				-22,000		
통안채 발행(91일), 낙찰수익률 3.550% 낙찰할인율 3.519%		-8,000	제기금 환수				-2,000		
국고채 발행(10년)		-9,000	세입				-8,000		
원천세 본납		-75,000	자금조정예금				-4,000		
자금조정예금		-4,000							
전일 기준	지준	-48,059	적수	-136,432	금일 예상	지준	-65,000	적수	-201,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.11.08(수)	180.0	197.1	3.48%	3.484%	3.520%		3.83%	3.868%	3.929%
2023.11.09(목)	180.4	195.5	3.55%	3.563%	3.569%		3.83%	3.847%	3.886%
2023.11.10(금)	180.3	190.0	3.58%	3.593%	3.596%	3.500%	3.83%	3.862%	3.905%
2023.11.13(월)	180.7	192.3	3.60%	3.575%	3.613%		3.83%	3.877%	3.927%
2023.11.14(화)	182.8		3.60%	3.579%	3.611%		3.83%	3.857%	3.905%

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
2023.11.09(목)	14:00~14:10	7	2023.11.16(목)	33.10	3.50%	0.50	1.5%	2023-058-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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
2023.11.14(화)	14:00~14:10	28	2023.12.12(화)	0.30	0.85	3.47%	0.30	2023-0040-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	에코아이	탄소배출권 전문 기업	2023.11.10(금) ~ 2023.11.13(월)	2023.11.15(수)	KB(1,776억)
공모주	한선엔지니어링	피팅 및 밸브 제조 기업	2023.11.13(월) ~ 2023.11.14(화)	2023.11.16(목)	대신(4.24조)
공모주	그린리소스	반도체 공정 설비 특수코팅 기업	2023.11.13(월) ~ 2023.11.14(화)	2023.11.16(목)	NH(2.06억)
실권주	한화오션	조선 및 해양플랜트 전문 기업	2023.11.13(월) ~ 2023.11.14(화)	2023.11.16(목)	대신, 신한, KB, 한투, NH, 한화 합계(4,378)
공모주	에이에스텍	자외선 차단 원료 제조 기업	2023.11.16(목) ~ 2023.11.17(금)	2023.11.21(화)	미래

관련 정보

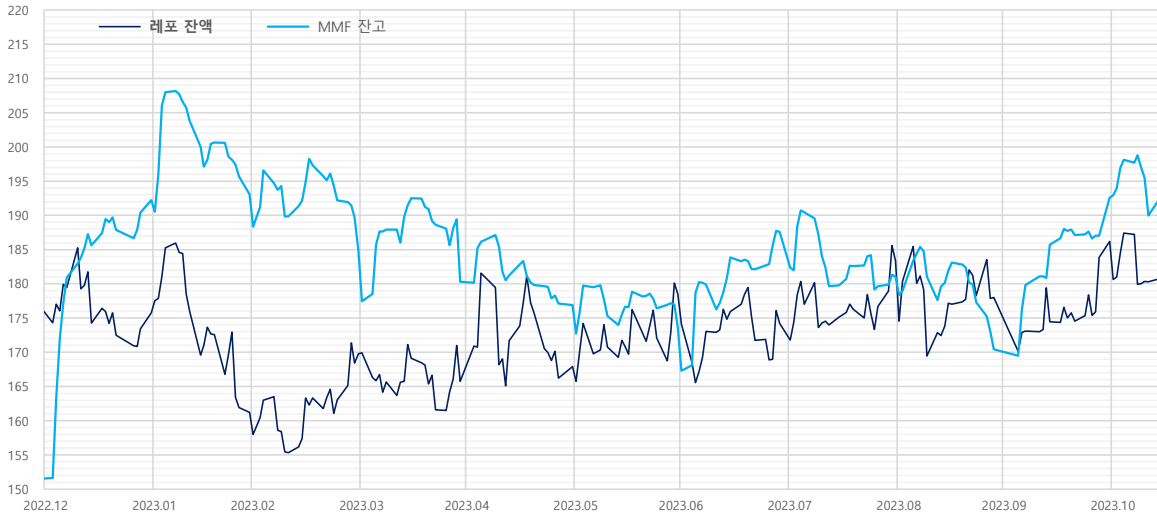
지준일	2023.12.06(수)	금통위	2023.11.30(목)	FOMC	2023.12.13(화) ~ 2023.12.14(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr	
· 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr	
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10078655&menuNo=200690	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)	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

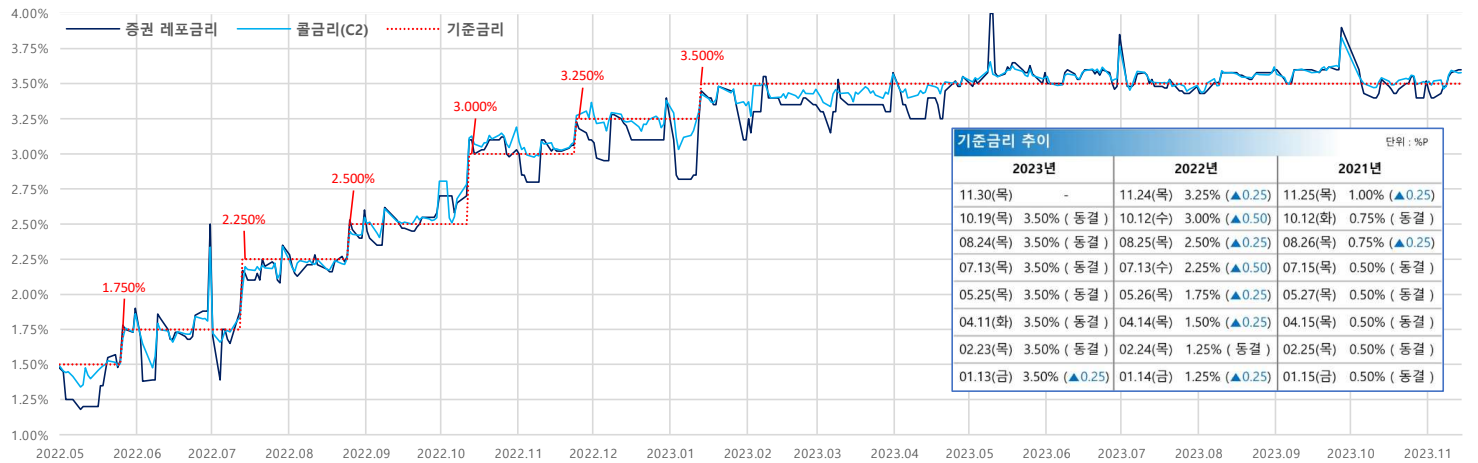
단위 : 조 원



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	3.8	22.5

자료 : 금융투자협회, 예탁결제원

단기금융시장 금리 추이

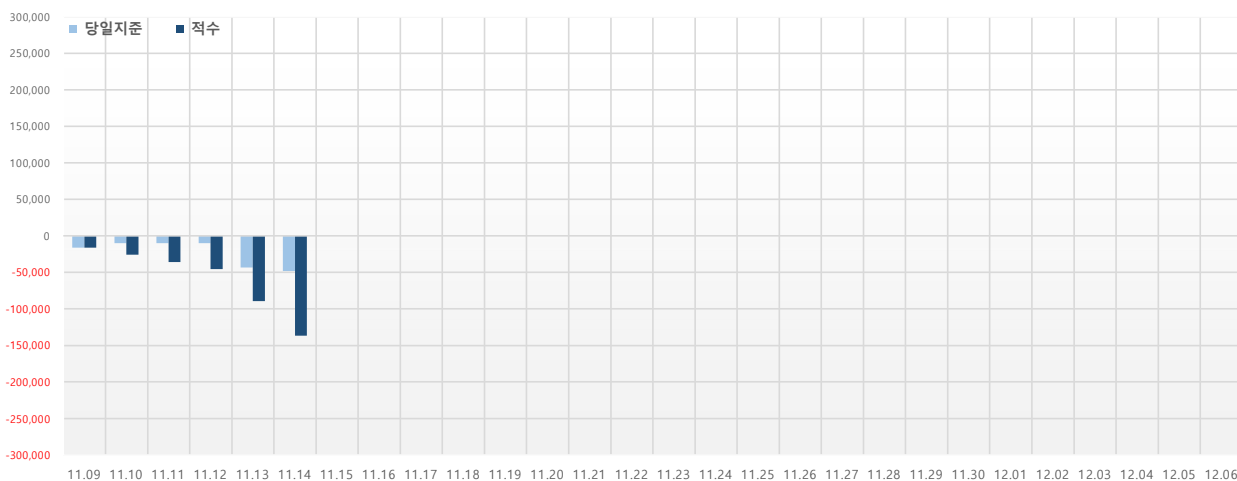


기준금리 추이			단위 : %P
2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	-	11.24(목) 3.25%	(▲0.25)
10.19(목)	3.50%	10.12(수) 3.00%	(▲0.50)
08.24(목)	3.50%	08.25(목) 2.50%	(▲0.25)
07.13(목)	3.50%	07.13(수) 2.25%	(▲0.50)
05.25(목)	3.50%	05.26(목) 1.75%	(▲0.25)
04.11(화)	3.50%	04.14(목) 1.50%	(▲0.25)
02.23(목)	3.50%	02.24(목) 1.25%	(동결)
01.13(금)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

자료 : 한국은행

당일지준 및 적수 추이

단위 : 억 원



	당일지준	적수
11.09(목)	-16,159	-16,159
11.10(금)	-9,939	-25,702
11.11(토)	-9,939	-35,641
11.12(일)	-9,939	-45,580
11.13(월)	-43,427	-89,007
11.14(화)	-48,059	-136,432
11.15(수)		
11.16(목)		
11.17(금)		
11.18(토)		
11.19(일)		
11.20(월)		
11.21(화)		
11.22(수)		
11.23(목)		
11.24(금)		
11.25(토)		
11.26(일)		
11.27(월)		
11.28(화)		
11.29(수)		
11.30(목)		
12.01(금)		
12.02(토)		
12.03(일)		
12.04(월)		
12.05(화)		
12.06(수)		