

레포 시장동향

◎ 전주

주초 국고여유자금 환수, 원천세 납부, 공모주(에코프로머티리얼즈) 청약 환불 등 자금 이탈 요인 많아 금리 상승했으며, 은행권 매수 의존도 증대되었음.
주중 재정 유입과 청약자금 운용으로 조달여건 일시적으로 호전되는 듯 했으나 주 전반에 걸친 국고금 환수 및 청약 영향으로 빠듯한 장세 계속되었음.
주말 전 은행권 조달 늘어나 건보자금 유입되었음에도 금리 추가 상승했으며, 운용금리 상승에 따른 매수 증가에 힘입어 수급 무난한 모습을 보임.

◎ 금일

지방소비세 유입 규모 상당하여 당일기준 크게 개선되었음, 공모주(에이에스텍) 청약자금 운용되어 조달여건 호전될 것으로 기대됨.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.11.17 (금)				2023.11.20 (월)			
공자기금		4,000		제기금		3,000	
재정 [경찰청0.5 국세환급0.1 실시간1.4]		20,000		재정 [지방소비세5.8 국세환급0.2 실시간1.2]		72,000	
자금조정예금 만기		5,000		자금조정예금 만기		5,000	
기타		4,000					
국고여유자금 환수		-1,000		국고여유자금 환수		-5,000	
국고채 비경쟁인수		-5,000		공자기금 환수		-3,000	
세입		-15,000		세입		-5,000	
자금조정예금		-5,000		자금조정예금		-5,000	
전일 기준	지준	-36,258	적수	금일 예상	지준	26,000	적수
							-332,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.11.13(월)	180.7	192.3	3.60%	3.575%	3.613%	3.500%	3.83%	3.877%	3.927%
2023.11.14(화)	182.8	194.6	3.60%	3.579%	3.611%		3.83%	3.857%	3.905%
2023.11.15(수)	182.7	196.9	3.55%	3.570%	3.569%		3.83%	3.744%	3.759%
2023.11.16(목)	186.1	199.1	3.60%	3.585%	3.617%		3.83%	3.701%	3.724%
2023.11.17(금)	184.4		3.63%	3.601%	3.639%		3.83%	3.681%	3.718%

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
2023.11.16(목)	14:00~14:10	7	2023.11.23(목)	37.70	3.50%	0.50	1.3%	2023-059-007

◎ 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	에이에스텍	자외선 차단 원료 제조 기업	2023.11.16(목) ~ 2023.11.17(금)	2023.11.21(화)	미래(6.77조)
공모주	에이텍	평판형 트랜스 제조 기업	2023.11.21(화) ~ 2023.11.22(수)	2023.11.24(금)	하나
공모주	엔에이치스팩30호	기업인수목적회사	2023.11.21(화) ~ 2023.11.22(수)	2023.11.24(금)	NH
공모주	와이바이오로직스	바이오 의약품 개발 기업	2023.11.23(목) ~ 2023.11.24(금)	2023.11.28(화)	유안타
공모주	교보15호스팩	기업인수목적회사	2023.11.23(목) ~ 2023.11.24(금)	2023.11.28(화)	교보
공모주	삼성스팩9호	기업인수목적회사	2023.11.23(목) ~ 2023.11.24(금)	2023.11.28(화)	삼성

관련 정보

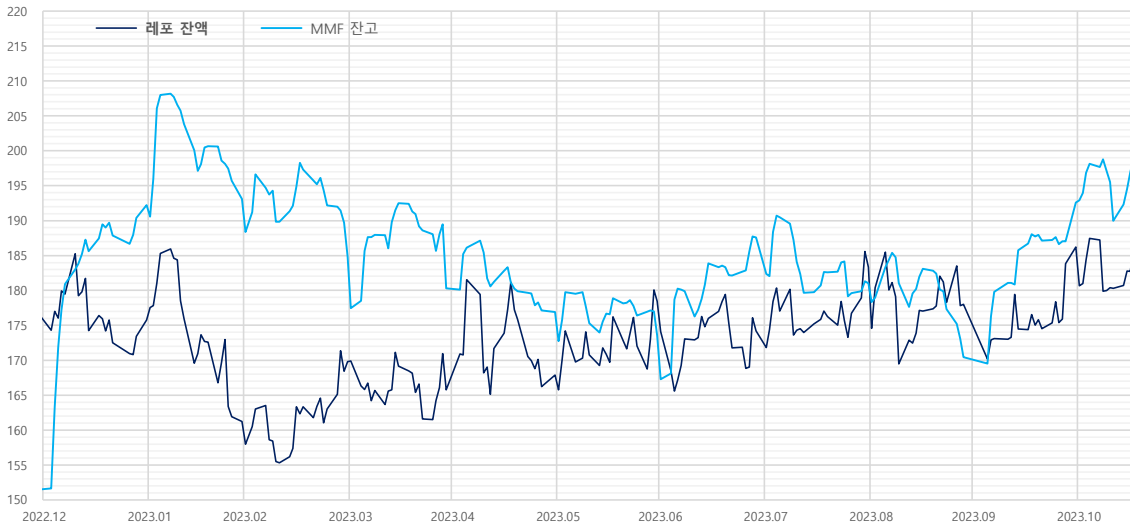
지준일	2023.12.06(수)	금통위	2023.11.30(목)	FOMC	2023.12.13(화) ~ 2023.12.14(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 2024년 금융통화위원회 정기회의 개최 및 의사록 공개 예정일정						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)		07.25(화) ~ 07.26(수)
2023년 8월	08.01(화)	08.31(목)	09.07(목)	10.11(수)	09.08(월)	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

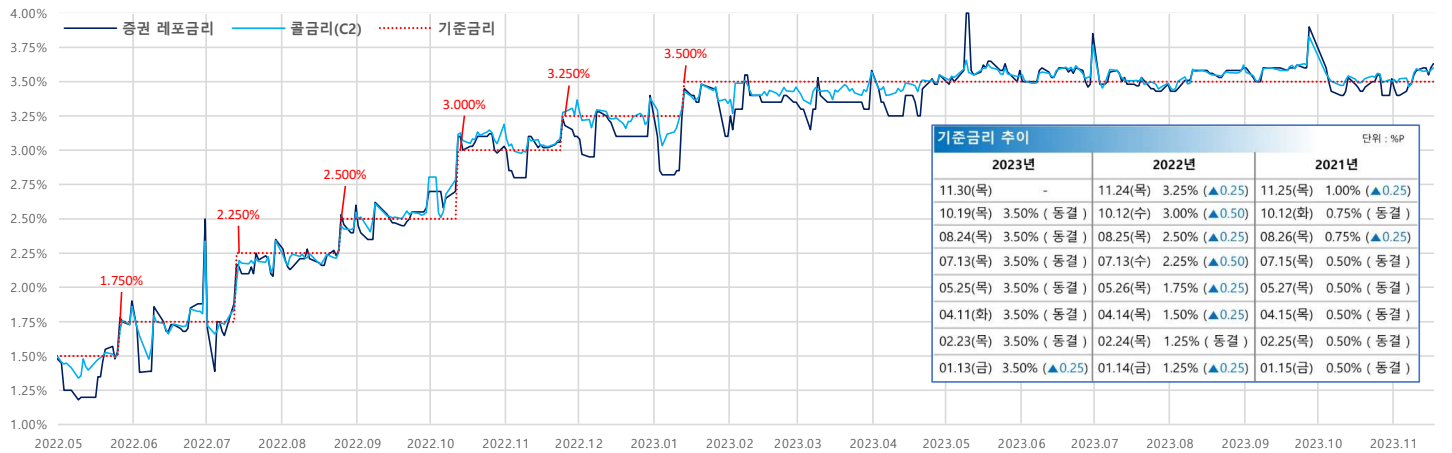
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	전월대비
2023.10.31	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, 메탁결제원

단기금융시장 금리 추이

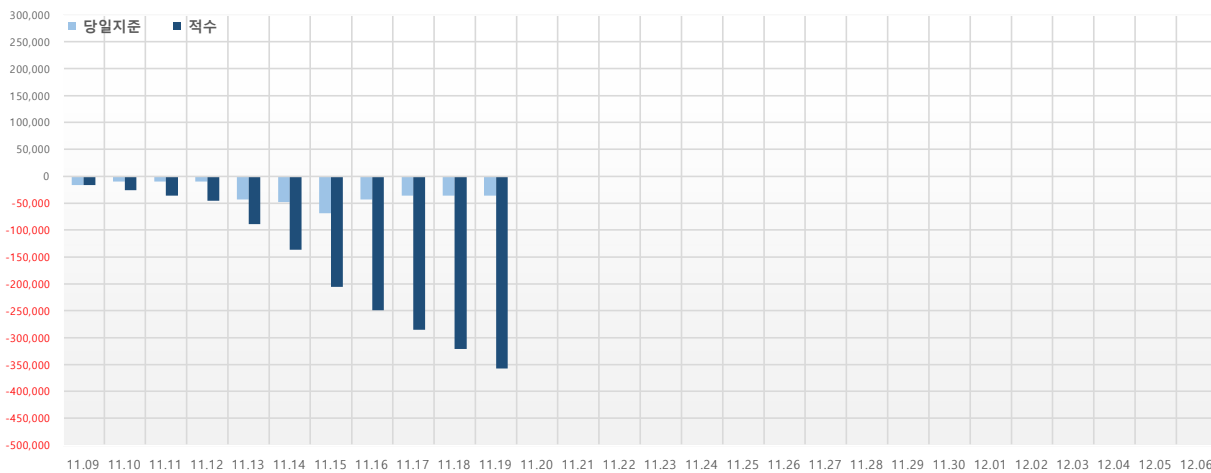


기준금리 추이			단위 : %P
2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)
10.19(목)	3.50% (동결)	10.12(수)	3.00% (▲0.50)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	1.75% (▲0.25)
04.11(화)	3.50% (동결)	04.14(목)	1.50% (▲0.25)
02.23(목)	3.50%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

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)	-68,589	-205,835
11.16(목)	-43,432	-248,736
11.17(금)	-36,258	-285,179
11.18(토)	-36,258	-321,437
11.19(일)	-36,258	-357,695
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)		