

레포 시장동향

◎ 전일

제기금 환수 및 청약 환불 흔재하여 공자기금 유입 규모 상당했음에도 유동성 개선되지 못함. 장중 추가 자금 유입되어 오후에 조달 정체 해소되었음.

◎ 금일

국고여유자금 추가 환수 영향으로 타이트한 장세 이어지겠으며, 은행권 적수 관리를 위한 조달에 집중할 전망. 익일물 및 기일물 레포금리 상승 예상됨.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2023.11.21 (화) | | | | 2023.11.22 (수) | | | | | |
|--|----|---------|----|-----------------------|-------|----|---------|----|----------|
| 통안계정 만기(28일) | | 5,000 | | 공자기금 | | | 3,000 | | |
| 통안채 만기(91일) | | 13,000 | | 재정 [국세환급0.3 실시간0.8] | | | 11,000 | | |
| 공자기금 | | 79,000 | | 자금조정예금 만기 | | | 7,000 | | |
| 재정 [국세환급0.1 실시간0.7] | | 8,000 | | | | | | | |
| 자금조정예금 만기 | | 6,000 | | | | | | | |
| 통안계정(28일) | | -3,000 | | 국고채 발행(20년) | | | -3,000 | | |
| 통안채 발행(91일), 낙찰수익률 3.500% 낙찰할인율 3.469% | | -8,000 | | 국고여유자금 환수 | | | -18,000 | | |
| 국고채 발행(5년) | | -8,000 | | 세입 | | | -11,000 | | |
| 국고여유자금 환수 | | -1,000 | | 자금조정예금 | | | -5,000 | | |
| 제기금 환수 | | -71,000 | | | | | | | |
| 세입 | | -4,000 | | | | | | | |
| 자금조정예금 | | -7,000 | | | | | | | |
| 기타 | | -4,000 | | | | | | | |
| 전일 기준 | 지준 | 22,373 | 적수 | -312,000 | 금일 예상 | 지준 | 6,000 | 적수 | -306,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2023.11.15(수) | 182.7 | 196.9 | 3.55% | 3.570% | 3.569% | 3.500% | 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 | 196.9 | 3.63% | 3.601% | 3.639% | | 3.83% | 3.681% | 3.718% |
| 2023.11.20(월) | 189.0 | 195.0 | 3.60% | 3.597% | 3.612% | | 3.83% | 3.667% | 3.700% |
| 2023.11.21(화) | 191.3 | | 3.60% | 3.585% | 3.613% | | 3.83% | 3.644% | 3.676% |

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

| | | | | | | | | | |
|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 2023.10.19(목) | 3.50% (동 결) | 2023.05.25(목) | 3.50% (동 결) | 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% (동 결) | 2023.04.11(화) | 3.50% (동 결) | 2022.11.24(목) | 3.25% (▲0.25) | 2022.07.13(수) | 2.25% (▲0.50) | 2022.02.24(목) | 1.25% (동 결) |
| 2023.07.13(목) | 3.50% (동 결) | 2023.02.23(목) | 3.50% (동 결) | 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 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 2023.10.31(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 |
| 2023.11.21(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2023.12.19(화) | 0.30 | 0.94 | 3.48% | 0.30 | 2023-0041-0028 |

청약 일정

| 구분 | 청약명 | 업체 | 모집일 | 환불일 | 주간사 / 인수사 (증거금) |
|-----|-----------|---------------|-------------------------------|---------------|-----------------|
| 공모주 | 에이팀 | 평판형 트랜스 제조 기업 | 2023.11.21(화) ~ 2023.11.22(수) | 2023.11.24(금) | 하나 (764억) |
| 공모주 | 엔에이치스팩30호 | 기업인수목적회사 | 2023.11.21(화) ~ 2023.11.22(수) | 2023.11.24(금) | NH (102억) |
| 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

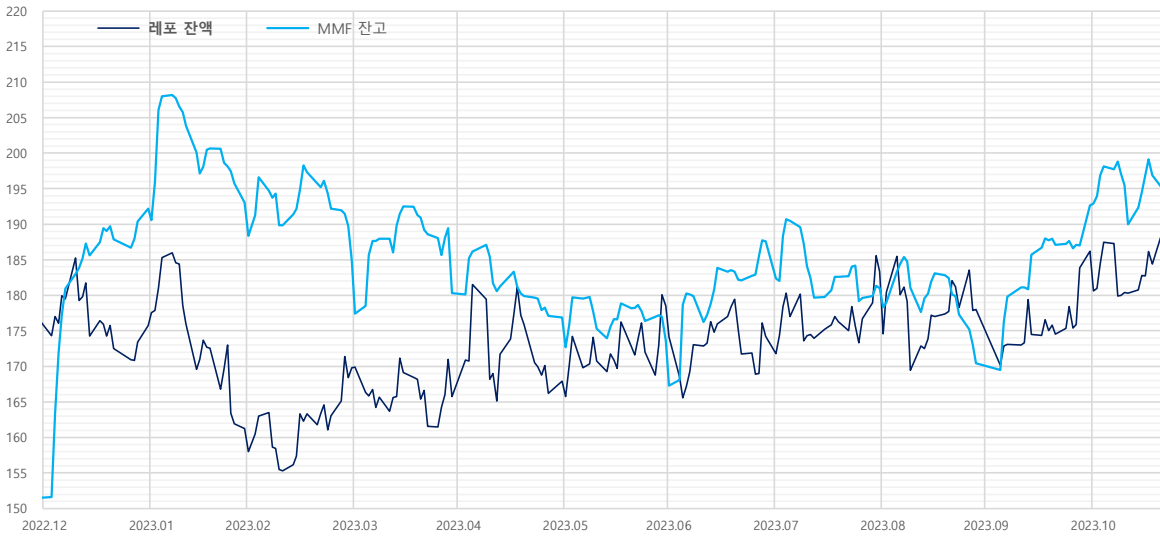
| 지준일 | 2023.12.06(수) | 금통위 | 2023.11.30(목) | FOMC | 2023.12.13(화) ~ 2023.12.14(수) | 한국은행 | http://www.bok.or.kr |
|--|---------------|-----|---------------|------|-------------------------------|---------|---|
| · 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호 | | | | | | 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) | | 06.13(화) ~ 06.14(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) | 07.25(화) ~ 07.26(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) | | 09.19(화) ~ 09.20(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

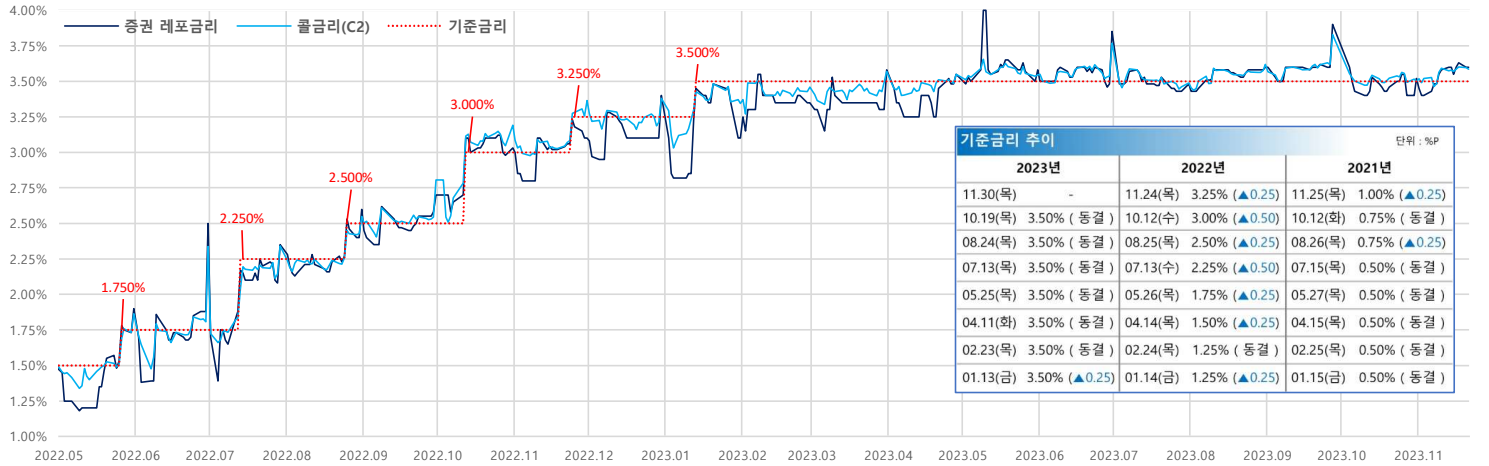
단위 : 조 원



| 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

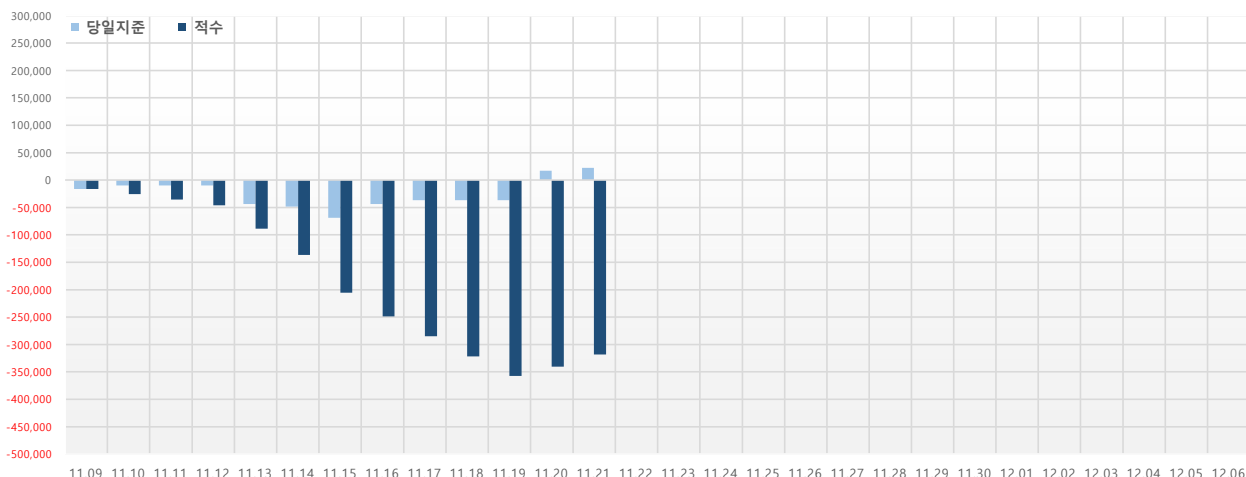


| 기준금리 추이 | | | | 단위 : %P | |
|----------|---------------|----------|---------------|----------|---------------|
| 2023년 | | 2022년 | | 2021년 | |
| 11.30(목) | - | 11.24(목) | 3.25% (▲0.25) | 11.25(목) | 1.00% (▲0.25) |
| 10.19(목) | 3.50% (동결) | 10.12(수) | 3.00% (▲0.50) | 10.12(화) | 0.75% (동결) |
| 08.24(목) | 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 |
|----------|---------|----------|
| 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) | 17,063 | -340,999 |
| 11.21(화) | 22,373 | -318,500 |
| 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) | | |