

레포 시장동향

◎ 전주

주초 지방소비세 및 청약자금(에이에스텍) 유입되어 금리 소폭 하락했으나 이후 주 전반에 걸쳐 국고 및 제기금 환수 계속되어 금리 상승 전환하였음.
주중 공모주 청약(에이엠/NH스팩30호)에 따른 자금 변동 심했으며, 월말대비 기일물 수요 증가했으나 매수-매도 호가 상이하여 거래 제한적이었음.
주말 앞두고 시은 조달 급증하여 부족세 심화될 것으로 예상됐으나 은행권의 적극적인 매수 참여에 힘입어 시장 이른 시간에 안정을 되찾았음.

◎ 금일

공모주 청약자금 운용 기대되나 국고금 환수 계속되어 은행권 매수 의존도 여전히 높겠음. 월말 및 금통위 앞두고 기일물 수요 증가할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.11.24 (금)					2023.11.27 (월)				
국고여유자금				29,000	재정 [국세환급0.1 실시간1.0]				11,000
재정 [국세환급0.1 실시간0.6]				7,000	자금조정예금 만기				5,000
자금조정예금 만기				6,000					
기타				2,000					
국고채 비경쟁인수				-4,000	공자기금 환수				-1,000
공자기금 환수				-24,000	국고여유자금 환수				-2,000
세입				-6,000	세입				-6,000
자금조정예금				-5,000	자금조정예금				-5,000
전일 기준	지준	17,447	적수	-275,042	금일 예상	지준	19,000	적수	-220,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.11.20(월)	189.0	195.0	3.60%	3.597%	3.612%	3.500%	3.83%	3.667%	3.700%
2023.11.21(화)	191.3	193.1	3.60%	3.585%	3.613%		3.83%	3.644%	3.676%
2023.11.22(수)	187.3	192.7	3.63%	3.620%	3.639%		3.83%	3.666%	3.704%
2023.11.23(목)	190.5	192.3	3.63%	3.598%	3.638%		3.84%	3.644%	3.677%
2023.11.24(금)	194.5		3.63%	3.606%	3.637%		3.84%	3.677%	3.721%

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
2023.11.23(목)	14:00~14:10	7	2023.11.30(목)	35.40	3.50%	0.50	1.4%	2023-060-007

◎ 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	와이바이오로직스	바이오 의약품 개발 기업	2023.11.23(목) ~ 2023.11.24(금)	2023.11.28(화)	유안타 (1.41조)
공모주	교보15호스팩	기업인수목적회사	2023.11.23(목) ~ 2023.11.24(금)	2023.11.28(화)	교보 (8,619억)
공모주	삼성스팩9호	기업인수목적회사	2023.11.23(목) ~ 2023.11.24(금)	2023.11.28(화)	삼성 (1.09조)
공모주	케이엔에스	이차전지 장비 제조 기업	2023.11.27(월) ~ 2023.11.28(화)	2023.11.30(목)	신영
공모주	LS머트리얼즈	울트라커패시터(UC) 제조 기업	2023.12.01(금) ~ 2023.12.04(월)	2023.12.06(수)	키움, KB / NH, 이베스트, 하이

관련 정보

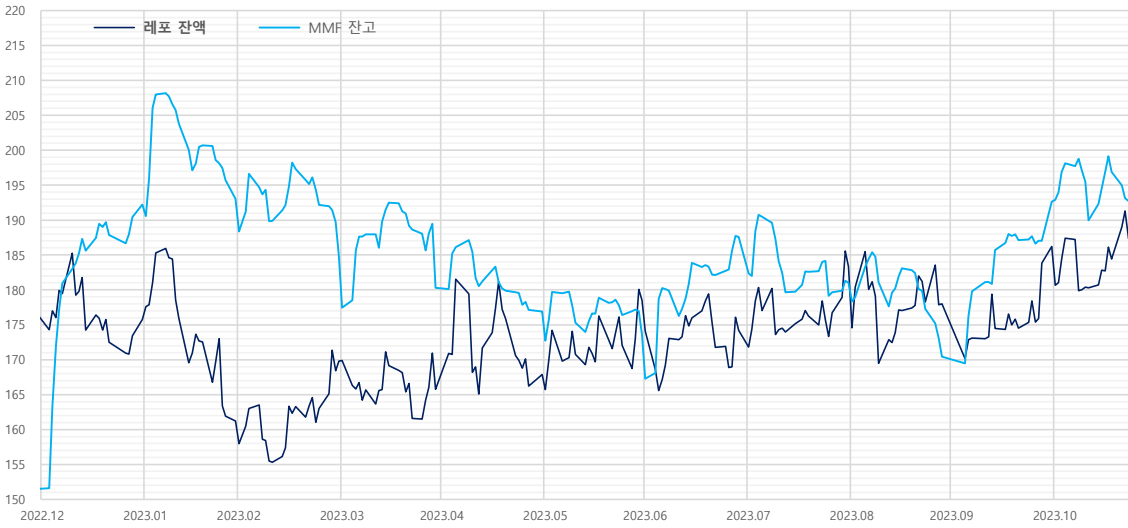
기준일	2023.12.06(수)	금통위	2023.11.30(목)	FOMC	2023.12.13(화) ~ 2023.12.14(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10078655&menuNo=200690		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 기준 계산, 적립기간, 금통위 및 FOMC 예정 일정표				www.traditionkorea.com/marketConditions.html?sca=0&sf1=&stx=&page=1&sca=1		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 11월	2023.11.01(수)	2023.11.30(목)	2023.12.07(목)	2024.01.10(수)	2023.11.30(목)	2023.11.09(목)		2023.12.12(화) ~ 2023.12.13(수) 01.30(화) ~ 01.31(수)
2023년 12월	2023.12.01(금)	2023.12.31(일)	01.11(목)	02.07(수)		2023.12.14(목)	2023.12.28(목)	
2024년 1월	01.01(월)	01.31(수)	02.08(목)	03.06(수)	01.11(목)	01.25(목)		
2024년 2월	02.01(목)	02.29(목)	03.07(목)	04.10(수)	02.22(목)	02.08(목)		
2024년 3월	03.01(금)	03.31(일)	04.11(목)	05.08(수)		03.14(목)	03.28(목)	03.19(화) ~ 03.20(수)
2024년 4월	04.01(월)	04.30(화)	05.09(목)	06.05(수)	04.12(금)	04.25(목)		04.30(화) ~ 05.01(수)
2024년 5월	05.01(수)	05.31(금)	06.06(목)	07.10(수)	05.23(목)	05.09(목)		06.11(화) ~ 06.12(수)
2024년 6월	06.01(토)	06.30(일)	07.11(목)	08.07(수)		06.13(목)	06.26(수)	07.30(화) ~ 07.31(수)
2024년 7월	07.01(월)	07.31(수)	08.08(목)	09.11(수)	07.11(목)	07.18(목)		
2024년 8월	08.01(목)	08.31(토)	09.12(목)	10.09(수)	08.22(목)	08.08(목)		09.17(화) ~ 09.18(수)
2024년 9월	09.01(일)	09.30(월)	10.10(목)	11.06(수)		09.12(목)	09.26(목)	
2024년 10월	10.01(화)	10.31(목)	11.07(목)	12.11(수)	10.11(금)	10.31(목)		11.06(수) ~ 11.07(목)
2024년 11월	11.01(금)	11.30(토)	12.12(목)	2025.01.08(수)	11.28(목)	11.14(목)		12.17(화) ~ 12.18(수)
2024년 12월	12.01(일)	12.31(화)	2025.01.09(목)	2025.02.05(수)		12.12(목)	12.24(화)	

레포 거래잔액 및 MMF 잔고 추이

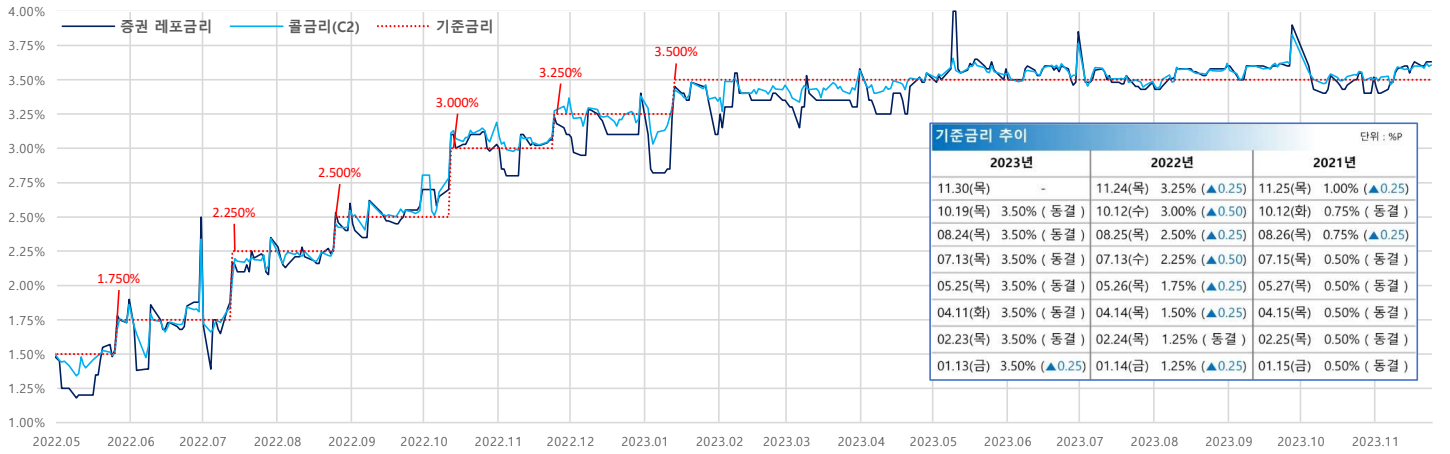
단위 : 조 원



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

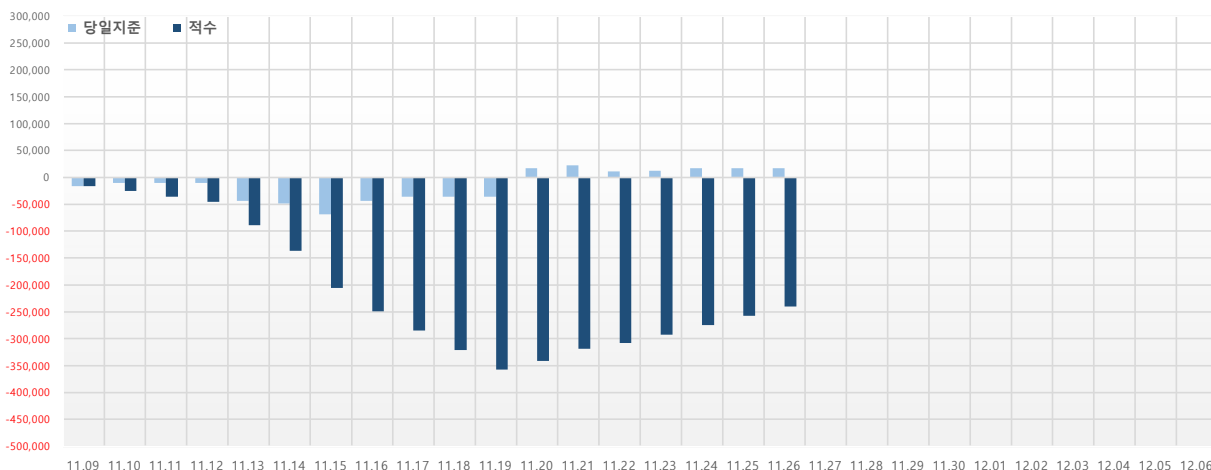


기준금리 추이				단위 : %P	
2023년	2022년	2021년			
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	3.50% (동결)	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	3.50% (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)	11,037	-307,559
11.23(목)	12,174	-292,484
11.24(금)	17,447	-275,042
11.25(토)	17,447	-257,595
11.26(일)	17,447	-240,148
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)		