

레포 시장동향

◎ 전주

주초 건보자금 본격적으로 유입됨에 따라 유동성 점차 풍부해졌으며, 운용사 및 신탁 매수 지속 추가되어 익일물 및 기일물 조달금리 하락하였음.
주중 공모주 청약자금 운용되어 저금리 거래 증가했고, 금통위 앞두고 있음에도 기일물 3.50%대 매칭되는 등 조달여건 매우 양호한 모습을 보임.
주말 전 국고여유자금 환수 및 건보자금 이탈 영향으로 레포금리 소폭 상승했으며, 시은 장 초반부터 적극적인 조달에 나서 수급 빠듯한 모습을 보임.

◎ 금일

공모주 청약(퀵리타스반도체) 환불에 따른 유동성 축소 예상되며, 콜레포 조달금리 수준에 따라 은행권 매도 강도 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.10.20 (금)				2023.10.23 (월)			
국고채 조기환매		30,000		재정 [국세환급0.1 실시간1.0]			11,000
재정 [국세환급0.1 실시간1.4]		15,000		자금조정예금 만기			4,000
자금조정예금 만기		7,000					
국고여유자금 환수		-7,000		국고여유자금 환수			-7,000
세입		-8,000		세입			-6,000
자금조정예금		-4,000		자금조정예금			-4,000
전일 기준	지준	27,776	적수	149,821	금일 예상	지준	26,000
						적수	232,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.10.16(월)	174.4	186.7	3.48%	3.518%	3.506%		3.82%	3.973%	4.064%
2023.10.17(화)	176.5	188.0	3.46%	3.493%	3.490%		3.82%	3.991%	4.092%
2023.10.18(수)	175.0	187.7	3.43%	3.492%	3.463%	3.500%	3.82%	4.031%	4.151%
2023.10.19(목)	175.8	188.0	3.43%	3.505%	3.466%		3.82%	4.070%	4.214%
2023.10.20(금)	174.5		3.46%	3.523%	3.492%		3.82%	4.033%	4.183%

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	회사번호
2023.10.19(목)	14:00~14:10	7	2023.10.26(목)	40.01	3.50%	2.00	5.0%	2023-055-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회사번호
2023.09.26(화)	14:00~14:10	28	2023.10.24(화)	0.50	0.65	3.55%	0.50	2023-0034-0028
2023.10.04(수)	14:00~14:10	27	2023.10.31(화)	0.50	0.78	3.53%	0.50	2023-0035-0027
2023.10.17(화)	14:00~14:10	27	2023.11.14(화)	0.50	1.72	3.47%	0.50	2023-0037-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	퀵리타스반도체	반도체 설계자산(IP) 전문 기업	2023.10.18(수) ~ 2023.10.19(목)	2023.10.23(월)	한투 (6.24조)
공모주	유투바이오	BT·IT 융합 헬스케어 솔루션 기업	2023.10.23(월) ~ 2023.10.24(화)	2023.10.26(목)	신한
공모주	유진테크놀로지	2차전지 생산 정밀금형 기업	2023.10.23(월) ~ 2023.10.24(화)	2023.10.26(목)	NH
실권주	코스모화학	2차전지 소재 기업	2023.10.23(월) ~ 2023.10.24(화)	2023.10.26(목)	KB, NH, 하나
공모주	KB제27호스팩	기업인수목적회사	2023.10.24(화) ~ 2023.10.25(수)	2023.10.27(금)	KB
공모주	서울보증보험	전업보증보험 전문 기업	2023.10.25(수) ~ 2023.10.26(목)	2023.10.30(월)	삼성, 미래
공모주	쏘닉스	무선통신필터 파운드리 전문 기업	2023.10.26(목) ~ 2023.10.27(금)	2023.10.31(화)	KB

관련 정보

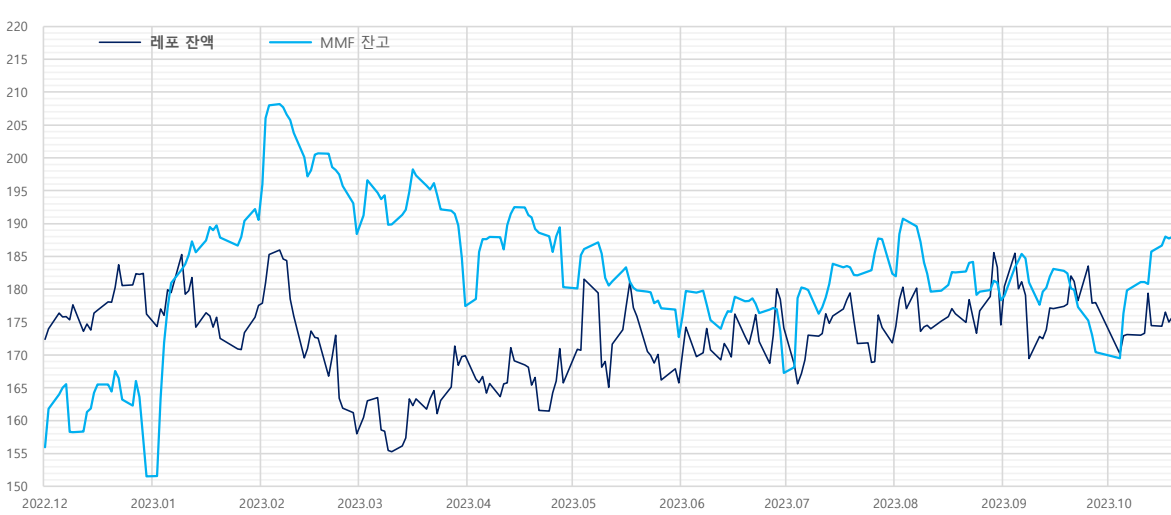
지준일	2023.11.08(수)	금통위	2023.11.30(목)	FOMC	2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 2023년 지준 계산·적립기간 및 금통위						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)	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)		
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

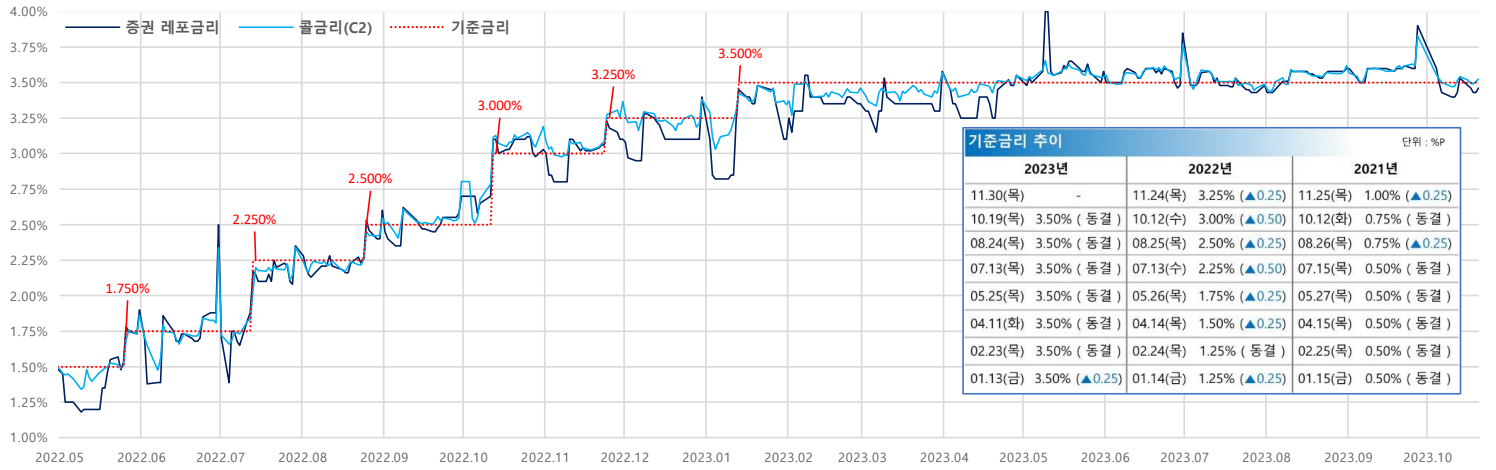
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	전월대비
2023.09.27	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

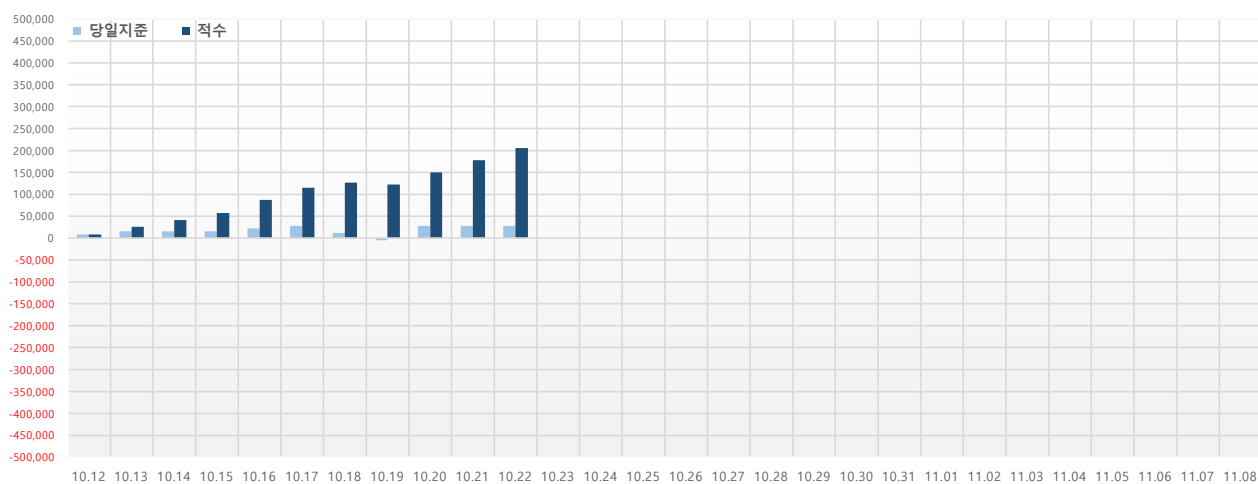


기준금리 추이			단위 : %P		
2023년	2022년	2021년	2023년	2022년	2021년
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25%	3.25%	1.00%
10.19(목)	3.50%	10.12(수)	3.00%	3.00%	0.75%
08.24(목)	3.50%	08.25(목)	2.50%	2.50%	0.75%
07.13(목)	3.50%	07.13(수)	2.25%	2.25%	0.50%
05.25(목)	3.50%	05.26(목)	1.75%	1.75%	0.50%
04.11(화)	3.50%	04.14(목)	1.50%	1.50%	0.50%
02.23(목)	3.50%	02.24(목)	1.25%	1.25%	0.50%
01.13(금)	3.50%	01.14(금)	1.25%	1.25%	0.50%

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)		
10.24(화)		
10.25(수)		
10.26(목)		
10.27(금)		
10.28(토)		
10.29(일)		
10.30(월)		
10.31(화)		
11.01(수)		
11.02(목)		
11.03(금)		
11.04(토)		
11.05(일)		
11.06(월)		
11.07(화)		
11.08(수)		