

레포 시장동향

◎ 전일

유동성 개선요인 없어 금리 보합 출발했으며, 당일기준 잉여폭 축소되어 시은 매도 증가하였음. 장 막판 추가 자금 저금리 매칭되었으나 그 규모는 제한적이었음.

◎ 금일

공자기금 및 근로장려금 유입 예정되어 있어 수급 양호할 것으로 기대되나 은행권 운용 규모와 조달 강도에 따라 장중 분위기 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.08.28 (월)				2023.08.29 (화)				
공자기금		4,000		통안계정 만기(28일)			22,200	
재정 [국세환급0.2 실시간0.1]		3,000		통안채 만기(91일)			16,000	
자금조정예금 만기		36,000		공자기금			29,000	
				재정 [근로장려금2.6 국세환급0.1 실시간0.2]			29,000	
				자금조정예금 만기			37,000	
국고채 비경쟁인수		-4,000		통안계정(28일)			-10,000	
제기금 환수		-6,000		통안채 발행(91일)			-13,000	
세입		-16,000		국고채 발행(30년)			-29,000	
자금조정예금		-37,000		세입			-14,000	
기타		-20,000		자금조정예금			-36,000	
전일 기준	지준	5,943	적수	금일 예상	지준	37,000	적수	-197,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.08.22(화)	178.4	184.0	3.53%	3.540%	3.550%	3.500%	3.70%	3.802%	3.867%
2023.08.23(수)	175.7	184.2	3.56%	3.560%	3.577%		3.69%	3.771%	3.825%
2023.08.24(목)	173.3	179.2	3.58%	3.572%	3.593%		3.69%	3.759%	3.803%
2023.08.25(금)	176.7	179.6	3.58%	3.565%	3.593%		3.69%	3.789%	3.843%
2023.08.28(월)	178.9		3.58%	3.563%	3.592%		3.69%	3.759%	3.796%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

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)
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)	2021.11.25(목) 1.00% (▲0.25)

한국은행 공개시장운영 잔액

◎ RP매각

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.08.24(목)	14:00~14:10	7	2023.08.31(목)	38.60	3.50%	4.00	10.4%	2023-044-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2023.08.01(화)	14:00~14:10	28	2023.08.29(화)	2.00	2.72	3.52%	2.22	2023-0028-0028
2023.08.16(수)	14:00~14:10	27	2023.09.12(화)	1.00	1.95	3.48%	1.00	2023-0029-0027
2023.08.22(화)	14:00~14:10	28	2023.09.19(화)	1.00	1.79	3.47%	1.00	2023-0030-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	한화플러스제4호스팩	기업인수목적회사	2023.08.29(화) ~ 2023.08.30(수)	2023.09.01(금)	한화

관련 정보

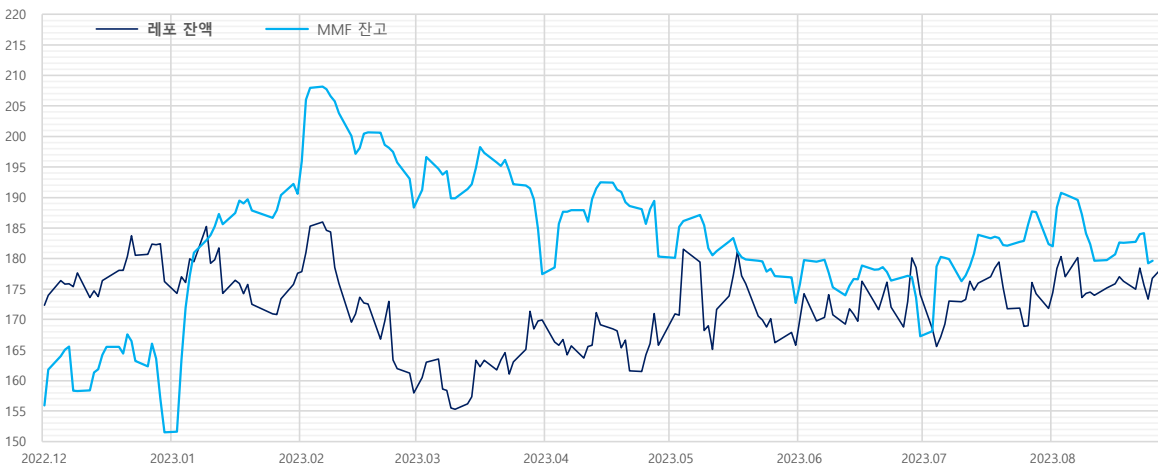
기준일	2023.09.06(수)	금통위	2023.10.19(목)	FOMC	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 2023년 지준 계산·적립기 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)	04.25(화)		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)		
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

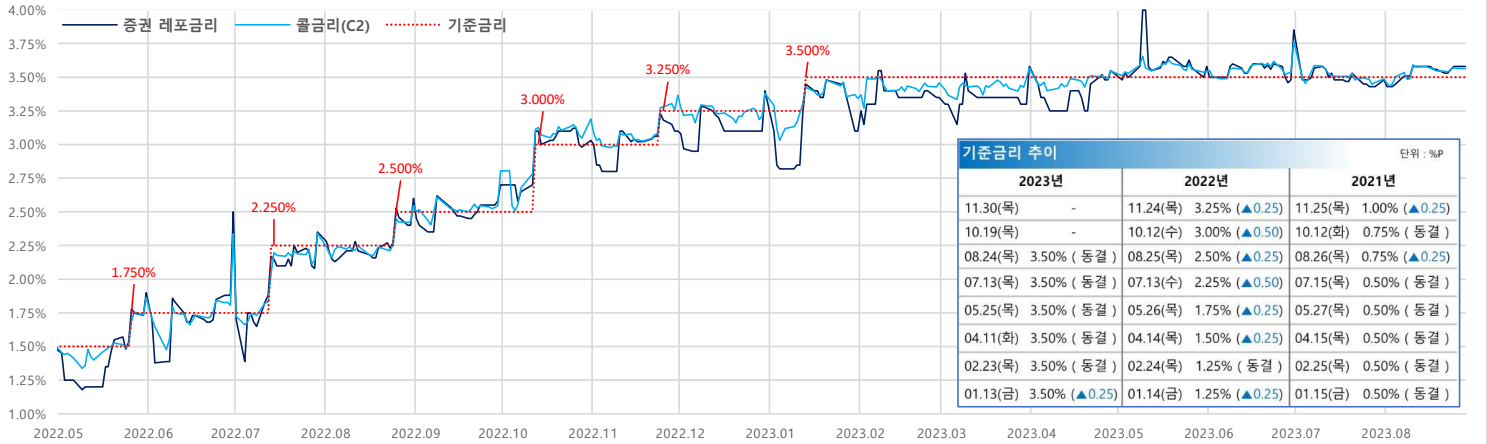
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전월대비	전월대비
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

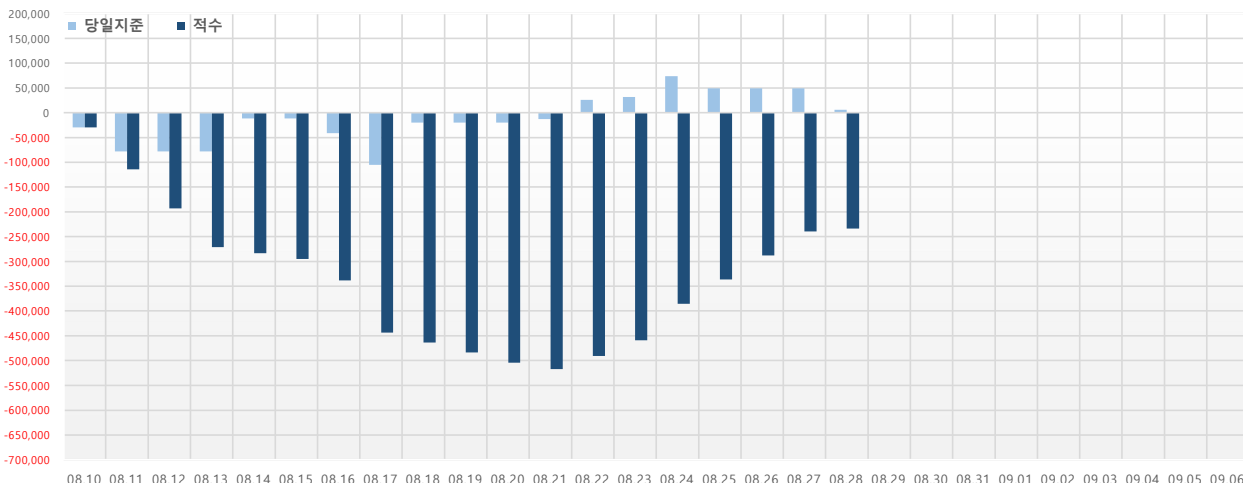


기준금리 추이				단위 : %P
	2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	-	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)	
10.19(목)	-	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)	
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)	
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수) 2.25% (▲0.50)	07.15(목) 0.50% (동결)	
05.25(목)	3.50% (동결)	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
08.10(목)	-29,481	-29,481
08.11(금)	-78,460	-114,153
08.12(토)	-78,460	-192,613
08.13(일)	-78,460	-271,073
08.14(월)	-12,000	-283,073
08.15(화)	-12,000	-295,073
08.16(수)	-40,894	-338,093
08.17(목)	-105,064	-443,125
08.18(금)	-20,375	-463,499
08.19(토)	-20,375	-483,874
08.20(일)	-20,375	-504,249
08.21(월)	-12,713	-516,957
08.22(화)	25,659	-490,798
08.23(수)	31,636	-459,162
08.24(목)	73,320	-385,345
08.25(금)	48,602	-336,743
08.26(토)	48,602	-288,141
08.27(일)	48,602	-239,539
08.28(월)	5,943	-233,597
08.29(화)		
08.30(수)		
08.31(목)		
09.01(금)		
09.02(토)		
09.03(일)		
09.04(월)		
09.05(화)		
09.06(수)		