

레포 시장동향

◎ 전주

주초 공자기금 및 근로장려금 유입되어 당일지준 잉여폭 확대되었으나 시은 콜-레포 조달에 적극적이었음.
공개시장운영(통안계정, 한은RP매각) 규모 감액했음에도 시장 수급 빠듯하여 주중 금리 높은 수준 유지되었음.
월말 MMF 환매 영향으로 부족세 심화되었으며, 월초에도 자금 회복 속도 더뎠다 은행권 매수 의존도 증대되었음.

◎ 금일

국고여유자금 유입 규모 상당하여 조달여건 크게 개선될 것으로 기대되며, 월말세입 규모에 따라 은행권 조달 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.09.01 (금)				2023.09.04 (월)			
공자기금		10,000		통안채 만기 및 이자(91일)			15,000
재정 [국세환급0.1 실시간0.9]		10,000		국고여유자금			156,000
자금조정예금 만기		42,000		재정 [국세환급0.4]			4,000
기타		9,000		자금조정예금 만기			35,000
				기타			36,000
금융중개지원대출 만기		-26,000		공자기금 환수			-10,000
국고채 비경쟁인수		-10,000		월말세입			-152,000
월말세입		-26,000		자금조정예금			-35,000
자금조정예금		-35,000					
전일 기준	지준	2,874	적수	-124,116	금일 예상	지준	52,000
						적수	-66,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.08.28(월)	178.9	179.9	3.58%	3.563%	3.592%	3.500%	3.69%	3.759%	3.796%
2023.08.29(화)	185.6	181.3	3.58%	3.564%	3.591%		3.69%	3.740%	3.776%
2023.08.30(수)	183.3	181.0	3.58%	3.577%	3.594%		3.69%	3.732%	3.780%
2023.08.31(목)	174.6	178.3	3.60%	3.620%	3.617%		3.69%	3.711%	3.750%
2023.09.01(금)	180.4		3.60%	3.567%	3.611%		3.68%	3.689%	3.717%

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
2023.08.31(목)	14:00~14:10	7	2023.09.07(목)	29.65	3.50%	1.50	5.1%	2023-045-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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
2023.08.29(화)	14:00~14:10	28	2023.09.26(화)	1.00	1.98	3.50%	1.00	2023-0031-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	상상인제4호스팩	기업인수목적회사	2023.09.04(월) ~ 2023.09.05(화)	2023.09.07(목)	상상인
실권주	피씨엘	체외 진단시약 개발 기업	2023.09.07(목) ~ 2023.09.08(금)	2023.09.12(화)	교보
실권주	보로노이	표적치료제 신약 개발 기업	2023.09.07(목) ~ 2023.09.08(금)	2023.09.12(화)	한투
실권주	디이엔티	반도체 및 FPD 기계 생산 기업	2023.09.07(목) ~ 2023.09.08(금)	2023.09.12(화)	대신

관련 정보

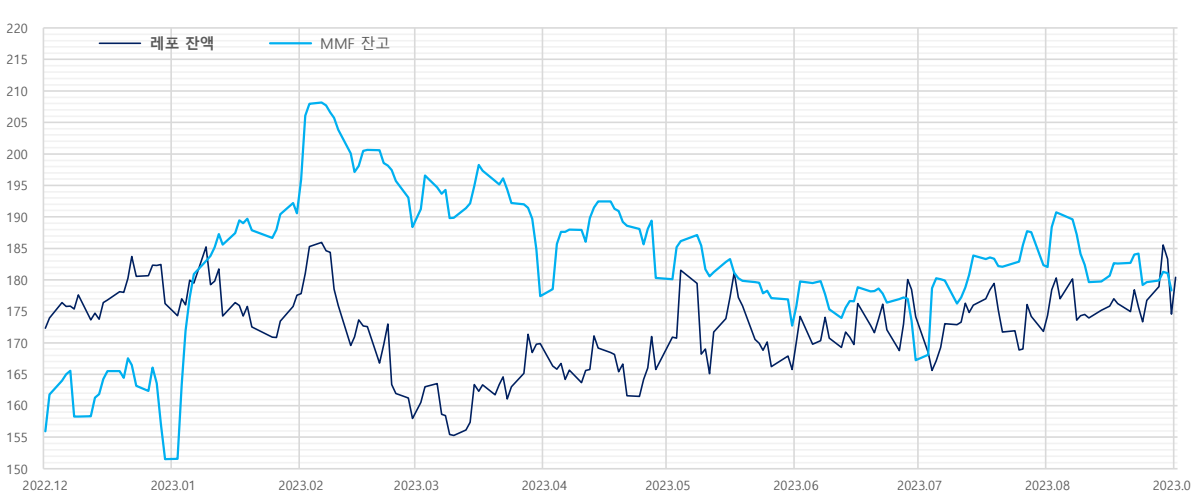
지준일	2023.09.06(수)	금통위	2023.10.19(목)	FOMC	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12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

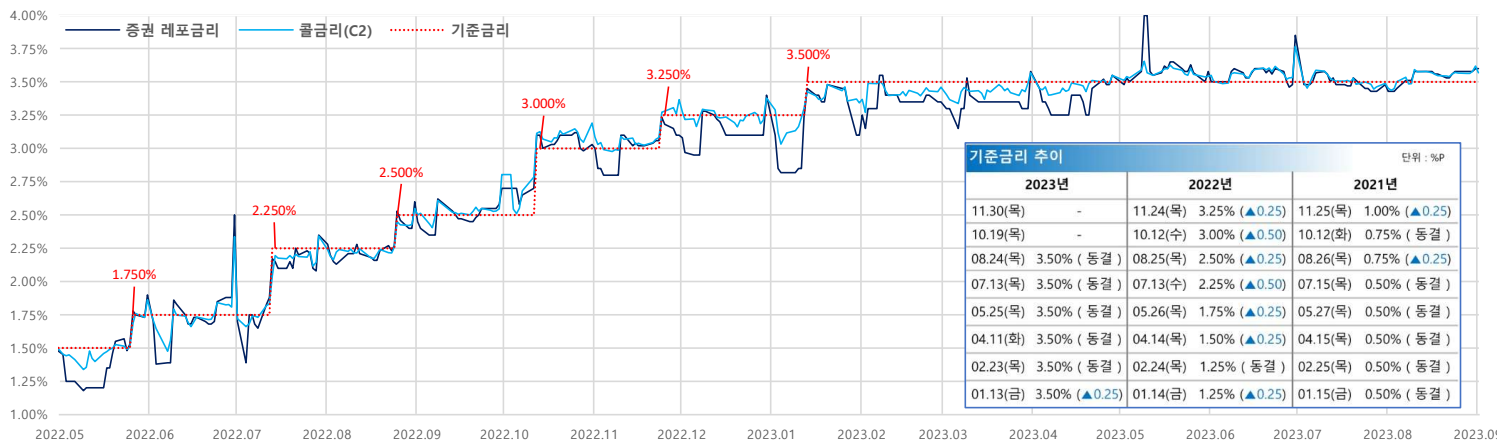
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	전월대비
2023.07.31	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

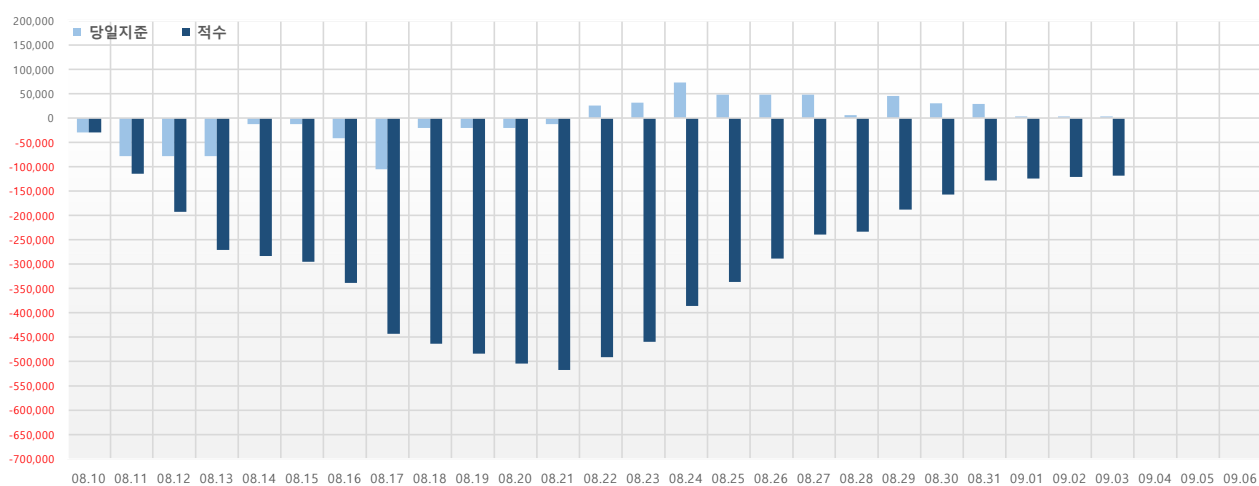


기준금리 추이			단위 : %P		
2023년	2022년	2021년	2023년	2022년	2021년
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	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
08.11(금)	-78,460
08.12(토)	-78,460
08.13(일)	-78,460
08.14(월)	-12,000
08.15(화)	-12,000
08.16(수)	-40,894
08.17(목)	-105,064
08.18(금)	-20,375
08.19(토)	-20,375
08.20(일)	-20,375
08.21(월)	-12,713
08.22(화)	25,659
08.23(수)	31,636
08.24(목)	73,320
08.25(금)	48,602
08.26(토)	48,602
08.27(일)	48,602
08.28(월)	5,943
08.29(화)	45,883
08.30(수)	30,391
08.31(목)	28,801
09.01(금)	2,874
09.02(토)	2,874
09.03(일)	2,874
09.04(월)	
09.05(화)	
09.06(수)	