

레포 시장동향

◎ 전일

국고여유자금 유입 규모 상당하여 조달여건 크게 개선되었으며, 장중 운용사 및 신탁 매수 추가되어 체결금리 하락하였음.

◎ 금일

타이트한 마감 예상되어 시은 콜-레포 조달 계속되었음. 시장 유동성 풍부하겠으나 은행 및 증권 조달 강도에 따라 분위기 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.09.04 (월)				2023.09.05 (화)				
통안채 만기 및 이자(91일)		15,000		공자기금 환수			31,000	
국고여유자금		157,000		재정 [국세환급0.6 실시간0.4]			10,000	
재정 [국세환급0.4]		4,000		자금조정예금 만기			35,000	
금융중개지원대출 신규		2,000						
자금조정예금 만기		35,000		통안채 발행(91일)			-10,300	
기타		28,000		국고채 발행(3년)			-21,000	
공자기금 환수		-10,000		국고여유자금 환수			-7,000	
월말세입		-152,000		세입			-13,000	
자금조정예금		-35,000		자금조정예금			-35,000	
전일 기준	지준	46,622	적수	금일 예상	지준	36,000	적수	-35,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.08.29(화)	185.6	181.3	3.58%	3.564%	3.591%	3.500%	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	179.0	3.60%	3.567%	3.611%		3.68%	3.689%	3.717%
2023.09.02(토)	185.5		3.53%	3.545%	3.544%		3.69%	3.738%	3.778%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

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)
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)	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	주관사 / 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

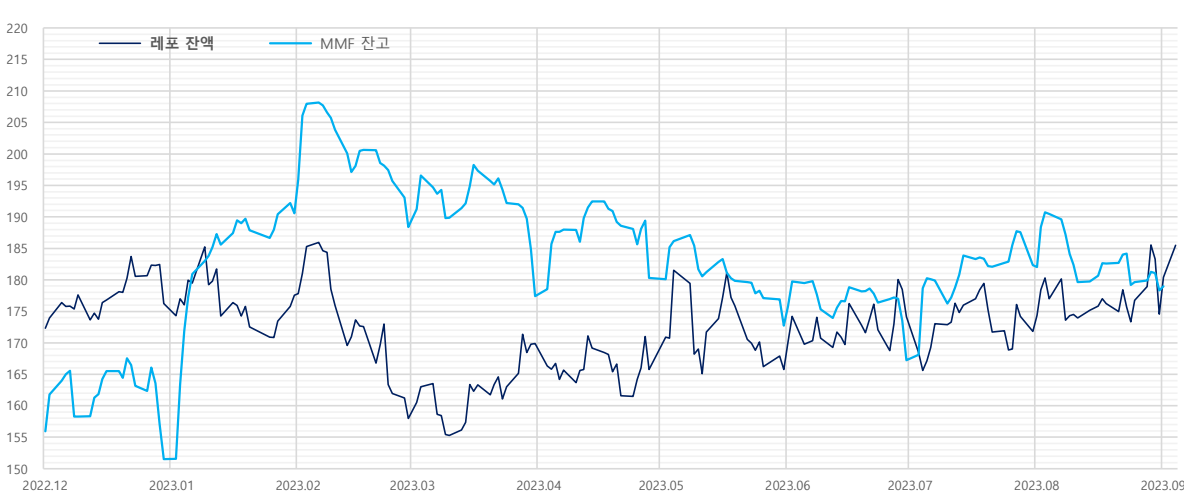
지준일	2023.09.06(수)	금통위	2023.10.19(목)	FOMC	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12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

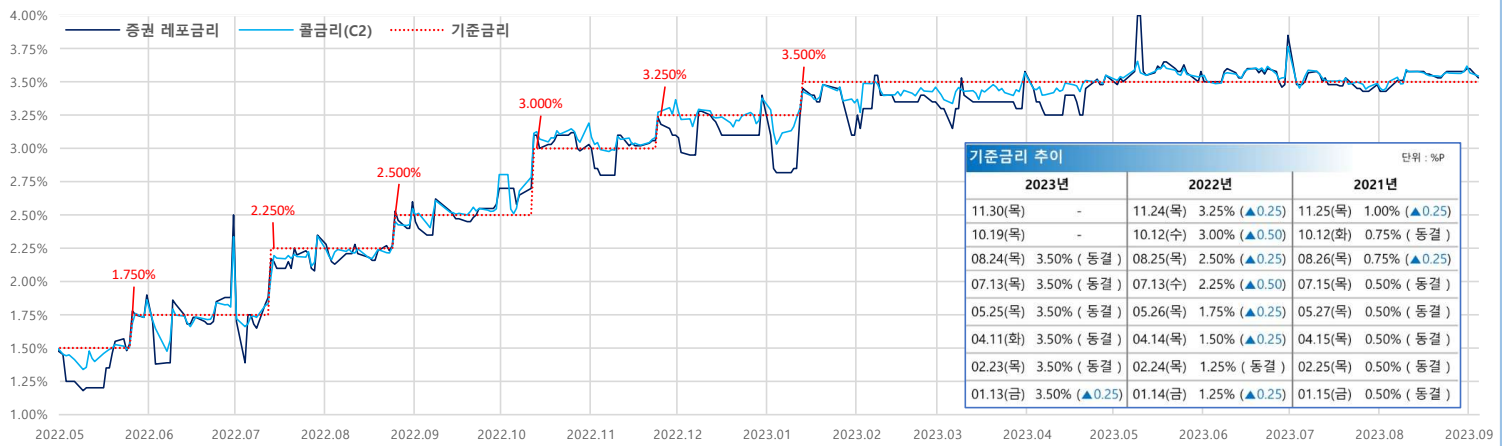
단위 : 조 원



해당연월	월말 MMF 증감내역		
	MMF	전월대비	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

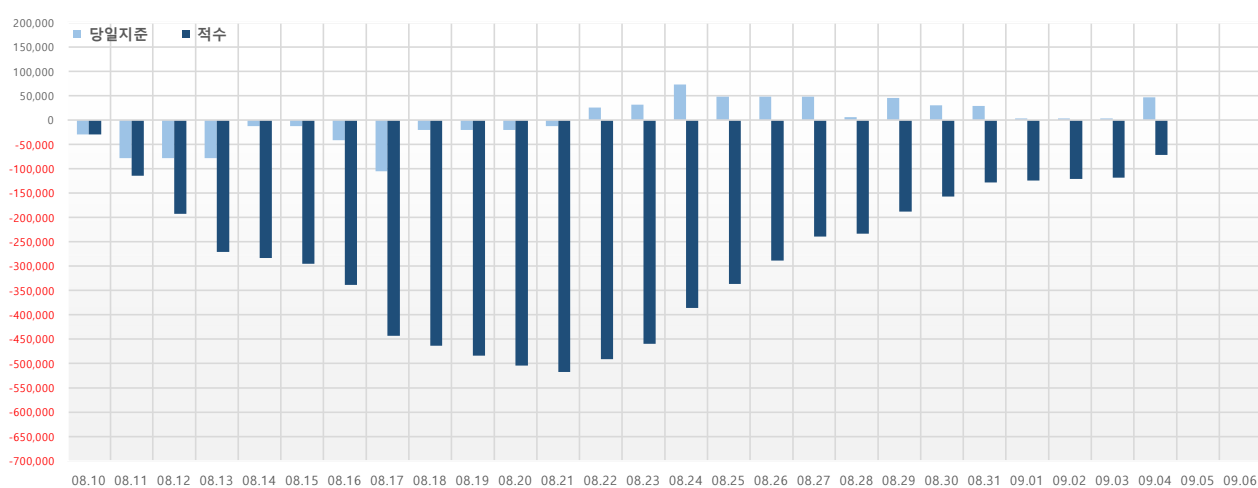


기준금리 추이			단위 : %P		
2023년	2022년	2021년	2023년	2022년	2021년
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	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)	46,622
09.05(화)	
09.06(수)	