

레포 시장동향

◎ 전일

1일물 롤오버를 제외한 신규 거래 제한적이었음. 은행권 부족세 강해 막판 한은RP매입으로 유동성 공급하여 마감함.

◎ 금일

국고금 유입 규모 크지 않아 타이트한 장세 유지될 것으로 예상되며, 은행권 조달 강도에 따라 수급 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위: 억 원

2023.09.06 (수)				2023.09.07 (목)					
한은RP매입(6일)		22,000		한은RP매각(7일)		15,000			
재정 (국방부1.3 국세환급1.4 실시간0.4)		31,000		재정증권 만기(63일)		15,000			
자금조정예금 만기		3,000		공자기금		14,000			
기타		2,000		국고여유자금		2,000			
				재정 (국방부0.5 국세환급0.8 실시간0.5)		18,000			
				자금조정예금 만기		4,000			
국고여유자금 환수		-36,000		한은RP매각(7일)		-10,000			
세입		-4,000		통안채 발행(2년)		-30,200			
자금조정예금		-4,000		국고채 발행(2년)		-14,000			
				재정증권 발행(63일)		-15,000			
				세입		-4,000			
				자금조정예금		-4,000			
전일 기준	지준	43,119	적수	543	금일 예상	지준	34,000	적수	34,000

Market Data

단위: 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.08.31(목)	174.6	178.3	3.60%	3.620%	3.617%	3.500%	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%
2023.09.04(월)	185.5	183.3	3.53%	3.545%	3.544%		3.69%	3.738%	3.778%
2023.09.05(화)	180.1	184.4	3.50%	3.510%	3.534%		3.70%	3.765%	3.814%
2023.09.06(수)	181.1		3.50%	3.496%	3.534%		3.71%	3.765%	3.816%

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

◎ RP매입

단위: 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.09.06(수)	16:40~16:50	6	2023.09.12(화)	2.34	3.50%	2.20	94.0%	2023-046-006

◎ 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 (1.1조)
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

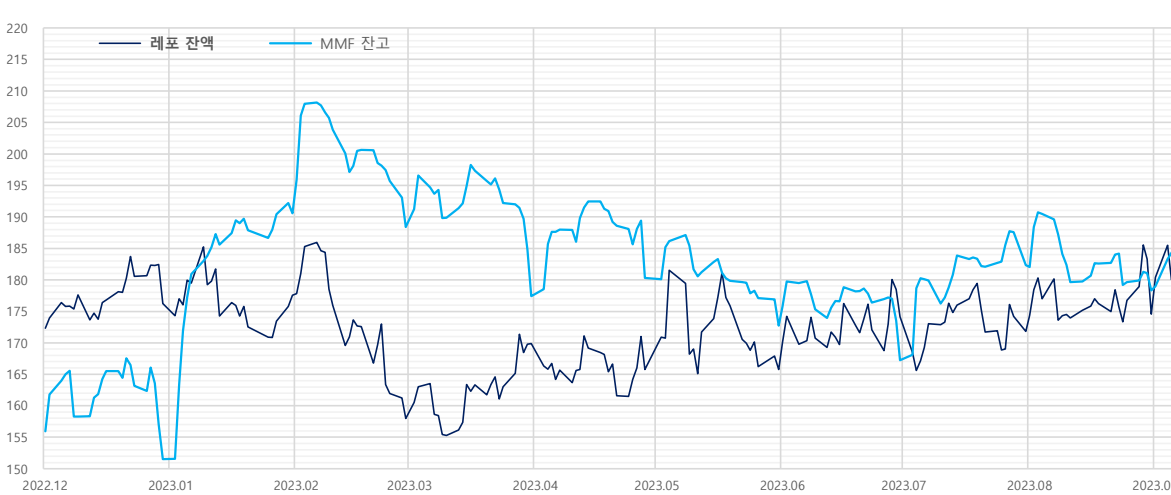
기준일	2023.10.11(수)	금통위	2023.10.19(목)	FOMC	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인	2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호					경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlId=10078655&menuNo=200690					무위험지표금리	https://www.kofr.kr
한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttlId=10068266&menuNo=200460					증권정보포털	https://seibro.or.kr
2023년 기준 계산·적립기간 및 금통위	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlId=10074187&menuNo=200295					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

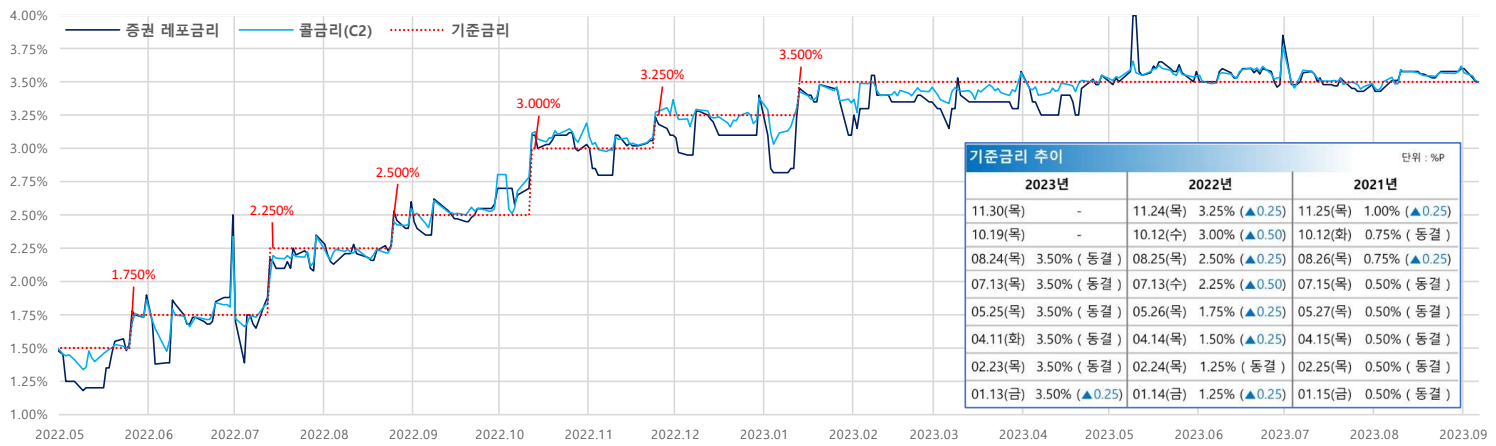
단위 : 조 원



해당연월	월말 MMF 증감내역		
	MMF	전월대비	전월대비
2023.08.31	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

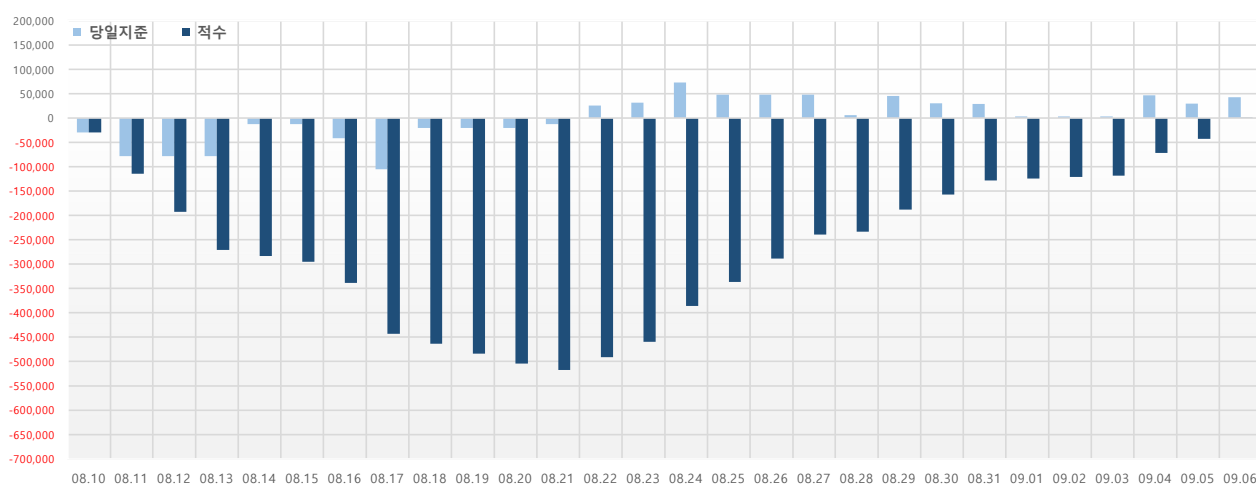


기준금리 추이			단위 : %P		
2023년	2022년	2021년	2023년	2022년	2021년
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	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)	29,193
09.06(수)	43,119