

레포 시장동향

◎ 전일

지준 마감 후 시은 매도 감소하여 수급 대체로 무난했으나 향후 유동성 감소 요인 많아 기일물 조달금리 상승하는 모습을 보임.

◎ 금일

차주 국고채 상환 재원 마련을 위한 대규모 국고금 환수 선행되어 장중 부족세 극심하겠음. 은행권 매수 의존도 증대되었으며, 조달금리 급등할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.09.07 (목)				2023.09.08 (금)					
한은RP매각 만기(7일)		15,000		통안채 만기(1년)		15,300			
재정증권 만기(63일)		15,000		재정 [국채환급0.6 실시간1.4]		20,000			
공자기금		14,000		자금조정예금 만기		4,000			
국고여유자금		3,000							
재정 [국채환급0.7 실시간0.8]		15,000							
자금조정예금 만기		4,000							
요지준 변동		8,000							
한은RP매각(7일)		-10,000		공자기금 환수		-217,000			
통안채 발행(2년), 낙찰수익률 3.810%		-30,200		국고여유자금 환수		-24,000			
국고채 발행(2년)		-14,000		제기금 환수		-60,000			
재정증권 발행(63일)		-15,000		세입		-4,000			
세입		-5,000		자금조정예금		-4,000			
자금조정예금		-4,000							
기타		-2,000							
전일 기준	지준	37,309	적수	37,309	금일 예상	지준	-232,000	적수	-195,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.09.01(금)	180.4	179.0	3.60%	3.567%	3.611%	3.500%	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	185.4	3.50%	3.496%	3.534%		3.71%	3.765%	3.816%
2023.09.07(목)	179.1		3.50%	3.540%	3.526%		3.72%	3.847%	3.893%

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
2023.09.07(목)	14:00~14:10	7	2023.09.14(목)	13.70	3.50%	1.00	7.3%	2023-047-007

◎ 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	인스웨이브시스템즈	기업용 소프트웨어 개발 기업	2023.09.14(목) ~ 2023.09.15(금)	2023.09.19(화)	신영
실권주	SK이노베이션	석유 정제품 제조 기업	2023.09.14(목) ~ 2023.09.15(금)	2023.09.19(화)	한투, NH, 신한, SK

관련 정보

지준일	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?nttid=10078655&menuNo=200690		무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttid=10068266&menuNo=200460		증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 2023년 지준 계산·적립기간 및 금통위				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttid=10074187&menuNo=200295		금융투자협회	https://kofiabond.or.kr

기준 계산·적립기간, 금통위 및 FOMC

	기준 계산기간		기준 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

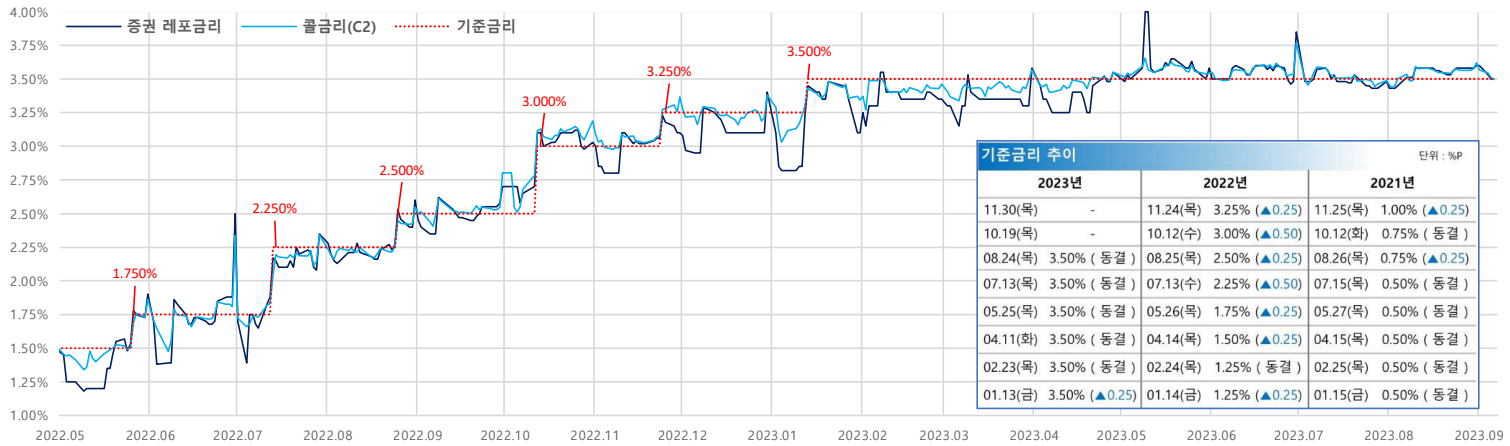
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	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

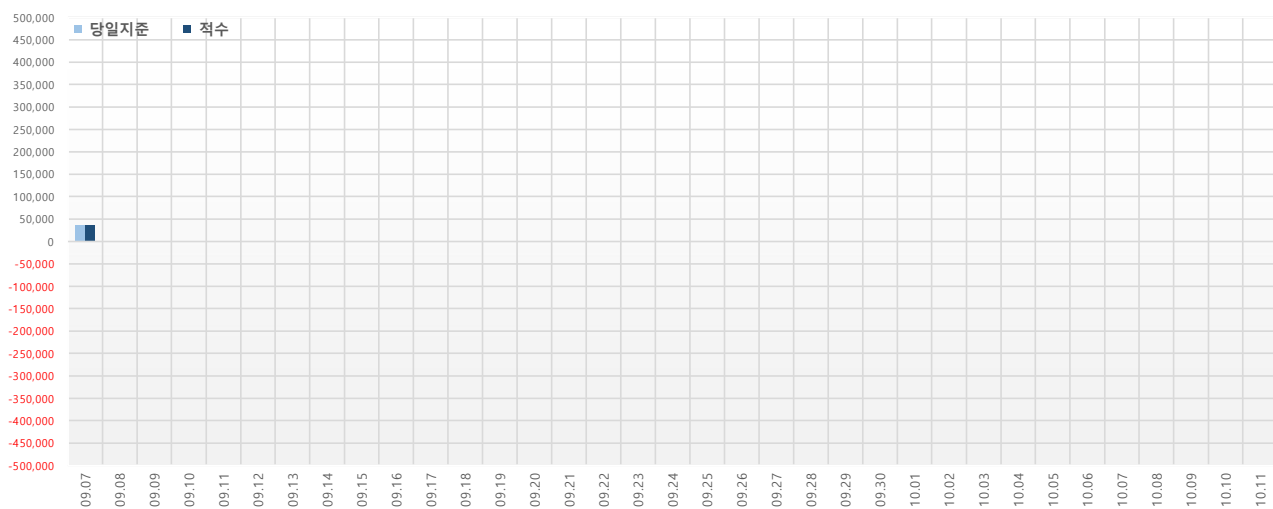


기준금리 추이				단위 : %P
	2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25%	(▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00%	(▲0.50)
08.24(목)	3.50%	08.25(목)	2.50%	(▲0.25)
07.13(목)	3.50%	07.13(수)	2.25%	(▲0.50)
05.25(목)	3.50%	05.26(목)	1.75%	(▲0.25)
04.11(화)	3.50%	04.14(목)	1.50%	(▲0.25)
02.23(목)	3.50%	02.24(목)	1.25%	(동결)
01.13(금)	3.50%	01.14(금)	1.25%	(▲0.25)
		01.15(금)	0.50%	(동결)

자료 : 한국은행

당일기준 및 적수 추이

단위 : 억 원



	당일기준	적수
09.07(목)		
09.08(금)		
09.09(토)	37,309	37,309
09.10(일)		
09.11(월)		
09.12(화)		
09.13(수)		
09.14(목)		
09.15(금)		
09.16(토)		
09.17(일)		
09.18(월)		
09.19(화)		
09.20(수)		
09.21(목)		
09.22(금)		
09.23(토)		
09.24(일)		
09.25(월)		
09.26(화)		
09.27(수)		
09.28(목)		
09.29(금)		
09.30(토)		
10.01(일)		
10.02(월)		
10.03(화)		
10.04(수)		
10.05(목)		
10.06(금)		
10.07(토)		
10.08(일)		
10.09(월)		
10.10(화)		
10.11(수)		