

레포 시장동향

◎ 전일

주초 국고여유자금 유입되어 조달여건 크게 개선되었고, 운용사 및 은행신탁 매수 충분하여 레포금리 기준금리 수준까지 하락하였음.
지준일 앞두고 시은 조달 증가했으나 2일물 자금 많지 않아 거래 제한적이었으며, 마감 당일까지 부족세 해소되지 않아 한은 유동성 지원하며 힘겹게 마감하였음.
국고채 상환 마련을 위한 대규모 국고금 환수 선행되어 주말 전 부족세 극심했고, 은행권 매수와 한은RP매입에 힘입어 가까스로 매도 해소되었음.

◎ 금일

국고채 만기 규모 상당하여 당일지준 호전되었으나 공자기금 추가 환수 및 한은RP매입 만기 겹쳐 수급 여전히 빠듯할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.09.08 (금)				2023.09.11 (월)				
한은RP매입(3일)		60,000		국고채 만기 및 이자			275,000	
통안채 만기(1년)		15,300		국고여유자금			21,000	
재정 [국세환급0.6 실시간1.5]		21,000		재정 [국세환급0.2 실시간1.2]			14,000	
자금조정예금 만기		4,000		자금조정예금 만기			4,000	
기타		18,000						
공자기금 환수		-217,000		한은RP매입 만기(3일)			-60,000	
국고여유자금 환수		-24,000		공자기금 환수			-26,000	
제기금 환수		-58,000		세입			-5,000	
세입		-5,000		자금조정예금			-4,000	
자금조정예금		-4,000		기타			-11,000	
전일 기준	지준	-164,469	적수	금일 예상	지준	44,000	적수	-411,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.09.04(월)	185.5	183.3	3.53%	3.545%	3.544%	3.500%	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	184.7	3.50%	3.540%	3.526%		3.72%	3.847%	3.893%
2023.09.08(금)	169.5		3.60%	3.593%	3.625%		3.72%	3.795%	3.837%

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
2023.09.07(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
2023.09.08(금)	14:30~14:40	3	2023.09.11(월)	10.30	3.50%	6.00	58.3%	2023-048-003

◎ 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)
실권주	씨제이씨지브이	엔터테인먼트 및 미디어 기업	2023.09.11(월) ~ 2023.09.12(화)	2023.09.14(목)	한투
실권주	에스씨엠생명과학	줄기세포 전문 기업	2023.09.11(월) ~ 2023.09.12(화)	2023.09.14(목)	한양
실권주	SK이노베이션	석유 정제품 제조 기업	2023.09.14(목) ~ 2023.09.15(금)	2023.09.19(화)	한투, NH, 신한, SK
공모주	인스웨이브시스템즈	기업용 소프트웨어 개발 기업	2023.09.14(목) ~ 2023.09.15(금)	2023.09.19(화)	신영

관련 정보

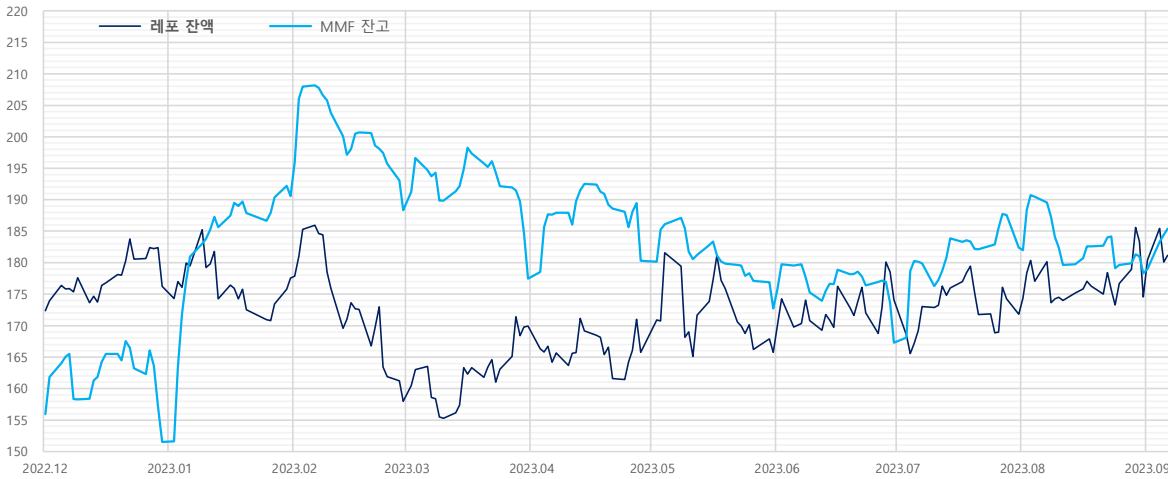
지준일	2023.10.11(수)	금통위	2023.10.19(목)	FOMC	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 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)		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

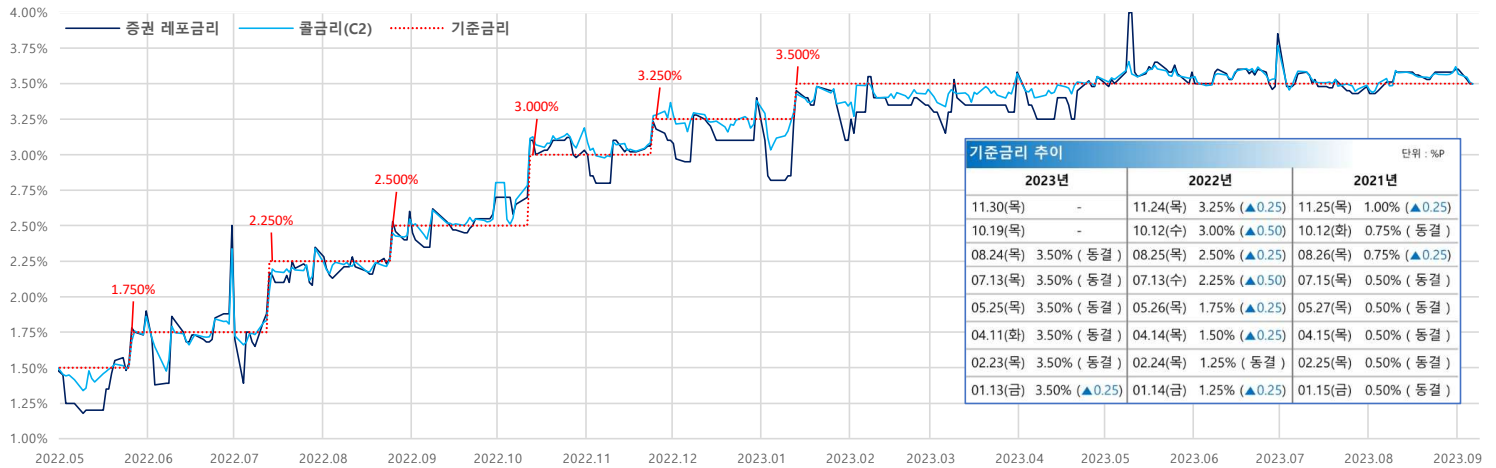
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	전월대비
2023.08.31	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

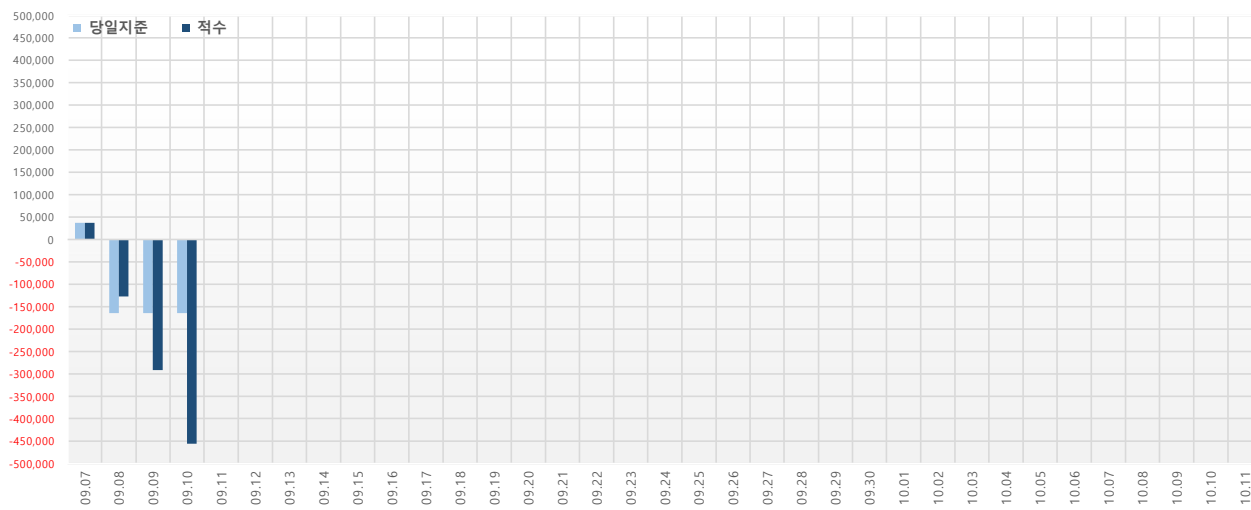


기준금리 추이				단위 : %P	
2023년	2022년	2021년			
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	3.50% (동결)	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
09.07(목)	37,309	37,309
09.08(금)	-164,469	-127,165
09.09(토)	-164,469	-291,634
09.10(일)	-164,469	-456,103
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)		