

레포 시장동향

◎ 전일
국고채 만기 규모 상당했음에도 시은 조달에 적극적이었으며, 원천세 납부 영향으로 유동성 축소되어 극심한 부족세 지속되었음.

◎ 금일
국고금 유입되어 조달여건 개선 기대되나 은행권 양방향 움직임에 따라 분위기 가변적일 전망. 시장 부족세 고려하여 통안계정 만기 수준 롤오버 예상됨.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.09.11 (월)			2023.09.12 (화)		
국고채 만기 및 이자	275,000	통안계정 만기(27일)	10,000		
국고여유자금	24,000	통안채 만기(91일)	13,000		
재정 [국세환급0.2 실시간0.7]	9,000	공자기금	24,000		
자금조정예금 만기	4,000	국고여유자금	13,000		
		재정 [국세환급0.1 실시간0.6]	7,000		
		자금조정예금	4,000		
한은RP매입 만기(3일)	-60,000	한은RP매입 만기(6일)	-22,000		
공자기금 환수	-26,000	통안계정(28일)	-10,000		
세입	-6,000	통안채 발행(91일), 낙찰수익률 3.630% 낙찰할인률 3.599%	-8,400		
자금조정예금	-4,000	국고채 발행(10년)	-19,000		
기타	-11,000	국고채 발행(50년)	-4,000		
		원천세 선납	-17,000		
		자금조정계금	-4,000		
전일 기준	지준	34,349	적수	-421,018	금일 예상
					지준
					21,000
					적수
					-400,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.09.05(화)	180.1	184.4	3.50%	3.510%	3.534%	3.500%	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	181.1	3.60%	3.593%	3.625%		3.72%	3.795%	3.837%
2023.09.11(월)	172.8		3.60%	3.602%	3.624%		3.72%	3.865%	3.894%

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

◎ 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)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10078655&menuNo=200690	무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttld=10068266&menuNo=200460	증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 2023년 지준 계산적립기간 및 금통위						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttld=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)	06.13(화) ~ 06.14(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)		10.31(화) ~ 11.01(수)
2023년 11월	11.01(수)	11.30(목)	12.07(목)	2024.01.10(수)	11.30(목)	11.09(목)		
2023년 12월	12.01(금)	12.31(일)	2024.01.11(목)	2024.02.07(수)		12.14(목)	12.28(목)	12.12(화) ~ 12.13(수)

레포 거래잔액 및 MMF 잔고 추이

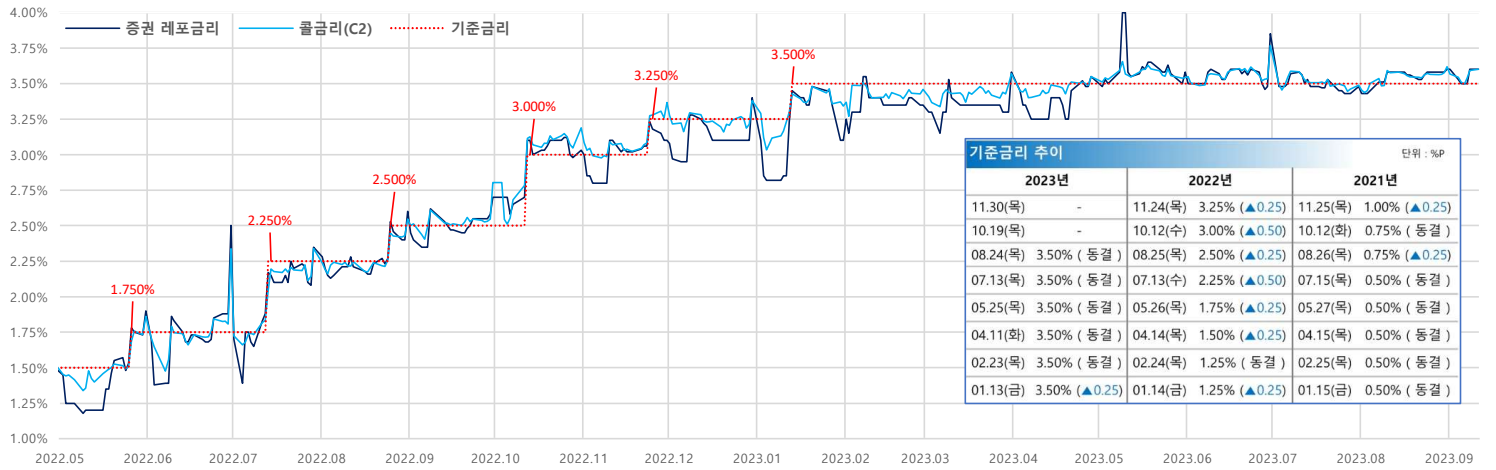
단위 : 조 원



해당연월	월말 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

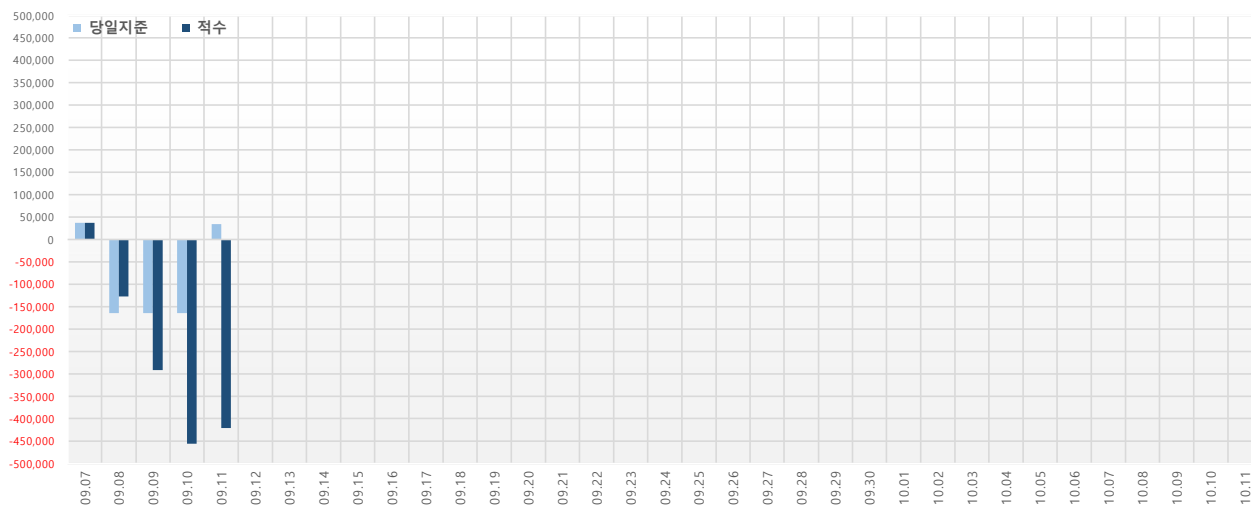


기준금리 추이			단위 : %P
2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	-	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수) 2.25% (▲0.50)	07.15(목) 0.50% (동결)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목) 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)	34,349	-421,018
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)		