

레포 시장동향

◎ 전일

국고 환수 영향으로 유동성 축소된 가운데 청약자금 운용 효과 크지 않아 조달여건 악화되었음. 시은 양방향 움직임 혼재했으며, 막판까지 수급 빠듯한 모습을 보임.

◎ 금일

한은RP매입 효과로 시은 조달 감소 기대되나 조달여건은 크게 개선되지 못하겠음. 공모주 청약에 따른 증권사 자금 항방과 은행권 움직임이 변수로 작용할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.09.20 (수)				2023.09.21 (목)			
한은RP매입(5일)		40,000		한은RP매각 만기(7일)			10,000
공자기금		3,000		통안채 중도환매			12,200
재정 [국채환급0.1 실시간1.5]		16,000		재정증권 만기(63일)			15,000
자금조정예금 만기		4,000		재정 [행안부 3.0 실시간1.0]			40,000
				자금조정예금 만기			4,000
국고여유자금 환수		-24,000		한은RP매각(6일)			-10,000
국고채 발행(20년)		-5,000		통안채 발행(3년), 낙찰수익률 4.000%			-12,200
세입		-5,000		재정증권 발행(63일)			-15,000
자금조정예금		-4,000		국고여유자금 환수			-19,000
화폐 발행		-5,000		세입			-5,000
				자금조정예금			-4,000
				화폐 발행			-5,000
전일 기준	지준	38,548	적수	-229,197	금일 예상	지준	50,000
						적수	-180,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.09.14(목)	177.2	181.9	3.60%	3.587%	3.620%	3.500%	3.76%	3.836%	3.863%
2023.09.15(금)	177.0	183.1	3.60%	3.580%	3.621%		3.78%	3.850%	3.881%
2023.09.18(월)	177.4	182.8	3.58%	3.583%	3.601%		3.79%	3.891%	3.934%
2023.09.19(화)	177.7	182.4	3.60%	3.609%	3.619%		3.80%	3.887%	3.916%
2023.09.20(수)	182.0		3.60%	3.619%	3.619%		3.81%	3.890%	3.916%

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

◎ RP매입

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.09.20(수)	16:30~16:40	5	2023.09.25(월)	10.35	3.50%	4.00	38.6%	2023-050-005

◎ RP매각

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.09.14(목)	14:00~14:10	7	2023.09.21(목)	18.47	3.50%	1.00	5.4%	2023-049-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2023.08.29(화)	14:00~14:10	28	2023.09.26(화)	1.00	1.98	3.50%	1.00	2023-0031-0028
2023.09.12(화)	14:00~14:10	28	2023.10.10(화)	0.50	1.07	3.48%	0.50	2023-0032-0028
2023.09.19(화)	14:00~14:10	28	2023.10.17(화)	0.50	0.68	3.48%	0.50	2023-0033-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	밀리의서재	독서 플랫폼 기업	2023.09.18(월) ~ 2023.09.19(화)	2023.09.21(목)	미래 (1.94조)
공모주	아이엠티	반도체 장비 기업	2023.09.18(월) ~ 2023.09.19(화)	2023.09.21(목)	유안타 (1.37조)
공모주	신한제11호스팩	기업인수목적회사	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	2023.09.22(금)	신한
공모주	레뷰코퍼레이션	인플루언서 마케팅 기업	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	2023.09.22(금)	삼성 (2.76조)
공모주	한씩	ICT 융합보안 솔루션 기업	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	2023.09.22(금)	KB (3.37조)
실권주	에이스테크놀로지	무선 통신 장비 제조 기업	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	2023.09.22(금)	SK
공모주	두산로보틱스	협동로봇 전문 기업	2023.09.21(목) ~ 2023.09.22(금)	2023.09.26(화)	한투, 미래, NH, KB / 키움, 신영, 하나

관련 정보

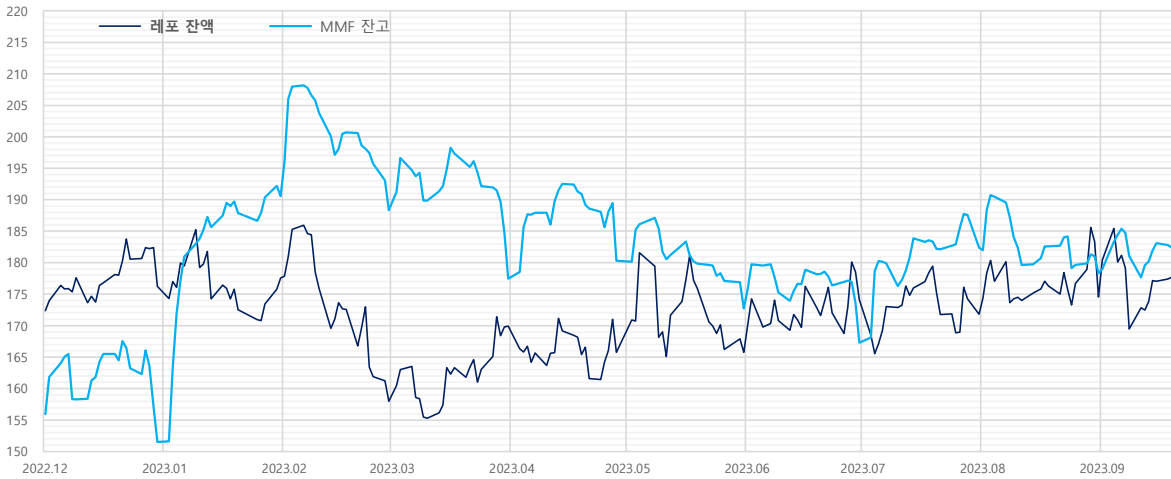
지준일	2023.10.11(수)	금통위	2023.10.19(목)	FOMC	2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttld=10078655&menuNo=200690		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)	
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

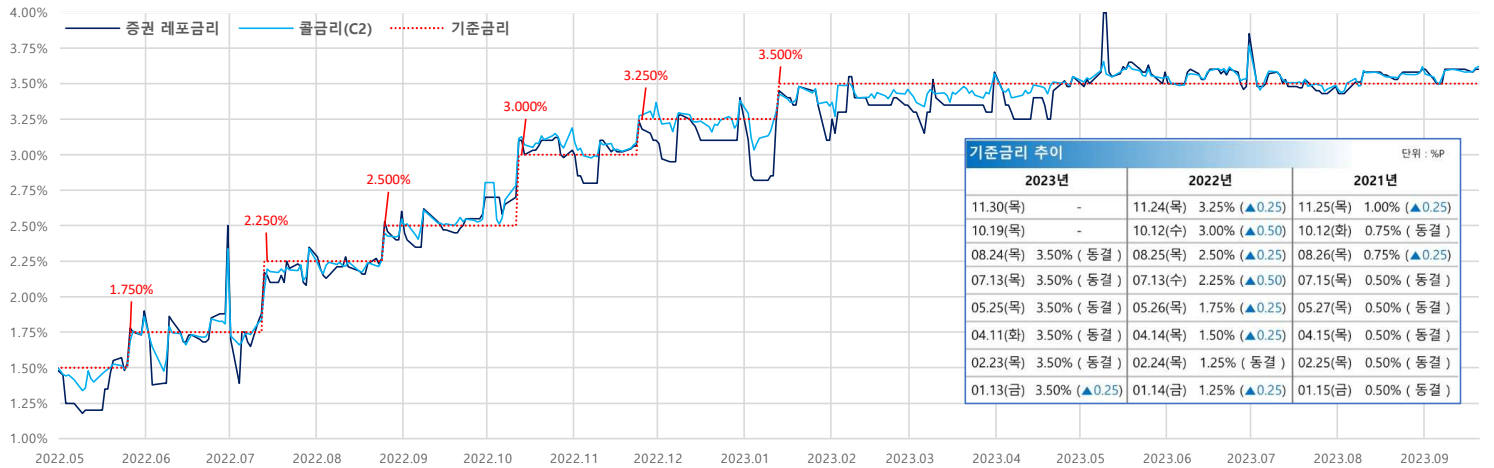
단위 : 조 원



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

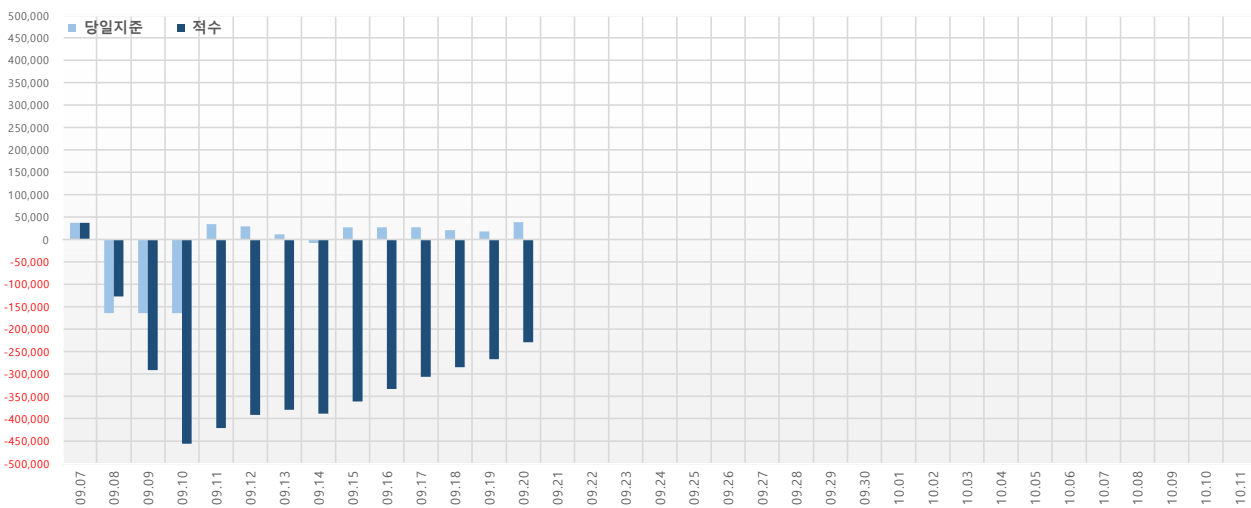


기준금리 추이				단위 : %P	
2023년	2022년	2021년			
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	3.50% (동결)	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)	34,349	-421,018
09.12(화)	29,380	-391,642
09.13(수)	11,165	-380,481
09.14(목)	-8,250	-388,727
09.15(금)	27,667	-361,648
09.16(토)	27,667	-333,981
09.17(일)	27,667	-306,314
09.18(월)	20,477	-285,370
09.19(화)	17,718	-267,855
09.20(수)	38,548	-229,197
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)		