

레포 시장동향

◎ 전일

유동성 회복 기대감으로 금리 급락했으며, 은행 및 신탁 매수에 힘입어 수급 원활하였음. 오후에 운용사 및 신탁 자금 추가 유입되어 잉여 분위기 형성됨.

◎ 금일

월말세입 및 한은RP매각 영향으로 은행권 운용 감소하겠으나 국고금 유입 규모 상당하여 조달여건 크게 개선될 것으로 기대됨.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2023.10.04 (수) | | | | 2023.10.05 (목) | | | | | |
|-----------------------|-----------|---------|-----------|--------------------------------|--------------|-----------|--------|-----------|---------|
| 통안채 만기(2년) | | 62,800 | | 한은RP매각 만기(14일) | | 10,000 | | | |
| 통안채 만기(90일) | | 14,200 | | 금융중개지원대출 | | 5,000 | | | |
| 통안채 이자 | | 6,000 | | 재정증권 만기(63일) | | 15,000 | | | |
| 재정증권 만기(63일) | | 15,000 | | 공자기금 | | 21,000 | | | |
| 재정 [국세환급0.1 실시간0.2] | | 3,000 | | 국고여유자금 | | 45,000 | | | |
| 자금조정예금 만기 | | 11,000 | | 재정 [국방부1.0 국세환급0.7 실시간0.2] | | 19,000 | | | |
| | | | | 자금조정예금 만기 | | 5,000 | | | |
| 한은RP매입 만기(8일) | | -50,000 | | 한은RP매각(7일) | | -30,000 | | | |
| 통안계정(27일) | | -5,000 | | 통안채 발행(2년, 낙찰수익률 4.020%) | | -18,600 | | | |
| 금융중개지원대출 만기 | | -36,000 | | 국고채 발행(30년) | | -21,000 | | | |
| 국고여유자금 환수 | | -11,000 | | 월말세입 | | -63,000 | | | |
| 세입 | | -12,000 | | 자금조정예금 | | -5,000 | | | |
| 자금조정예금 | | -5,000 | | | | | | | |
| 기타 | | -1,000 | | | | | | | |
| 전일 기준 | 지준 | 9,106 | 적수 | 115,978 | 금일 예상 | 지준 | -8,000 | 적수 | 107,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2023.09.22(금) | 178.3 | 177.3 | 3.62% | 3.618% | 3.662% | 3.500% | 3.83% | 3.876% | 3.921% |
| 2023.09.25(월) | 183.5 | 175.2 | 3.60% | 3.630% | 3.622% | | 3.83% | 3.876% | 3.927% |
| 2023.09.26(화) | 177.8 | 173.1 | 3.60% | 3.620% | 3.672% | | 3.83% | 3.891% | 3.954% |
| 2023.09.27(수) | 178.0 | 170.4 | 3.90% | 3.829% | 4.019% | | 3.83% | 3.884% | 3.942% |
| 2023.10.04(수) | 170.2 | | 3.60% | 3.555% | 3.620% | | 3.84% | 4.108% | 4.203% |

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 | 예정금액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰금액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|--------------|
| 2023.09.21(목) | 14:00~14:10 | 14 | 2023.10.05(목) | 1.00 | 3.63 | 3.49% | 1.00 | 2023-051-014 |

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정금액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰금액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 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 |
| 2023.09.26(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2023.10.24(화) | 0.50 | 0.65 | 3.55% | 0.50 | 2023-0034-0028 |
| 2023.10.04(수) | 14:00~14:10 | 27 | 2023.10.31(화) | 0.50 | 0.78 | 3.53% | 0.50 | 2023-0035-0027 |

청약 일정

| 구분 | 청약명 | 업체 | 모집일 | 환불일 | 주간사 / 인수사 (증거금) |
|-----|---------------|---------------|-------------------------------|---------------|-----------------|
| 공모주 | 퓨릿 | 반도체 소재 기업 | 2023.10.05(목) ~ 2023.10.06(금) | 2023.10.11(수) | 미래 |
| 공모주 | 에스엘에스바이오(코넥스) | 의약품 품질관리 기업 | 2023.10.10(화) ~ 2023.10.11(수) | 2023.10.13(금) | 하나 |
| 공모주 | 신성에스티 | 2차전지 부품 제조 기업 | 2023.10.10(화) ~ 2023.10.11(수) | 2023.10.13(금) | 미래 |

관련 정보

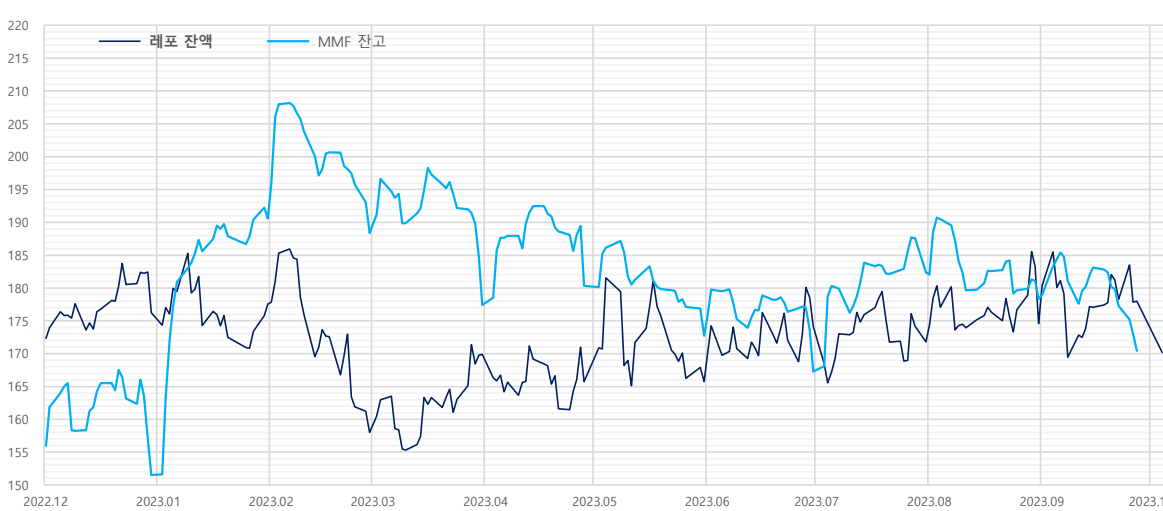
| | | | | | | | | |
|--|---------------|------------|---------------|-------------|-------------------------------|--|---|---|
| 지준일 | 2023.10.11(수) | 금통위 | 2023.10.19(목) | FOMC | 2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수) | 한국은행 | http://www.bok.or.kr | |
| · 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 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?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 지준 계산·적립기간 및 금통위 | | | | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlId=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) | 09.25(월) | | 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) | 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

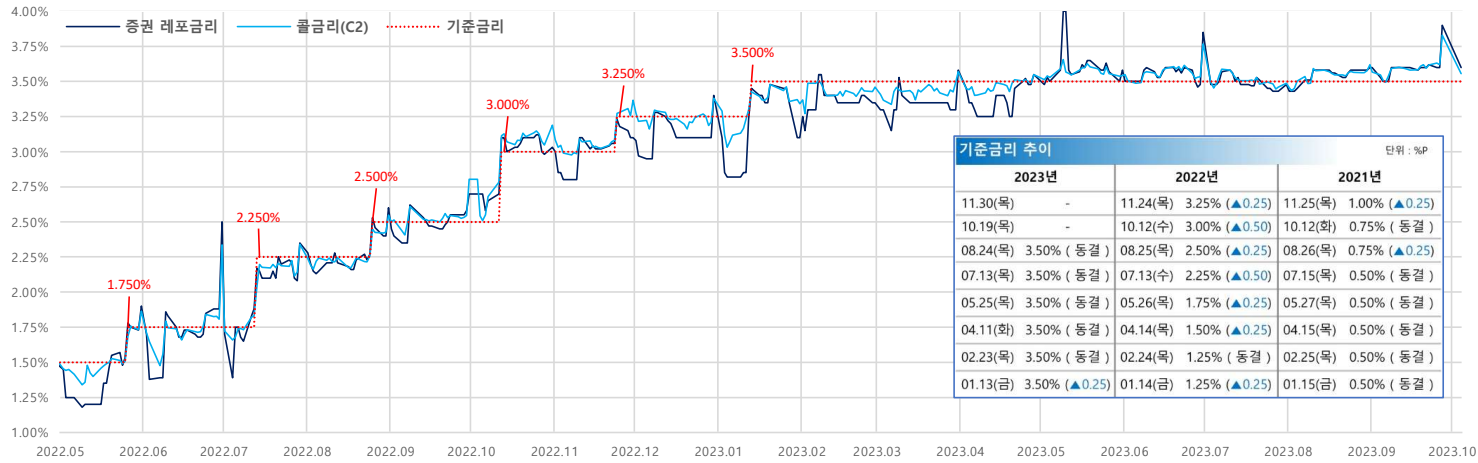
단위 : 조 원



| 해당연월 | 월말일 MMF 증감내역 | | |
|------------|--------------|------|-------|
| | MMF | 전일대비 | 전월대비 |
| 2023.09.27 | 170.4 | -2.6 | -7.9 |
| 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

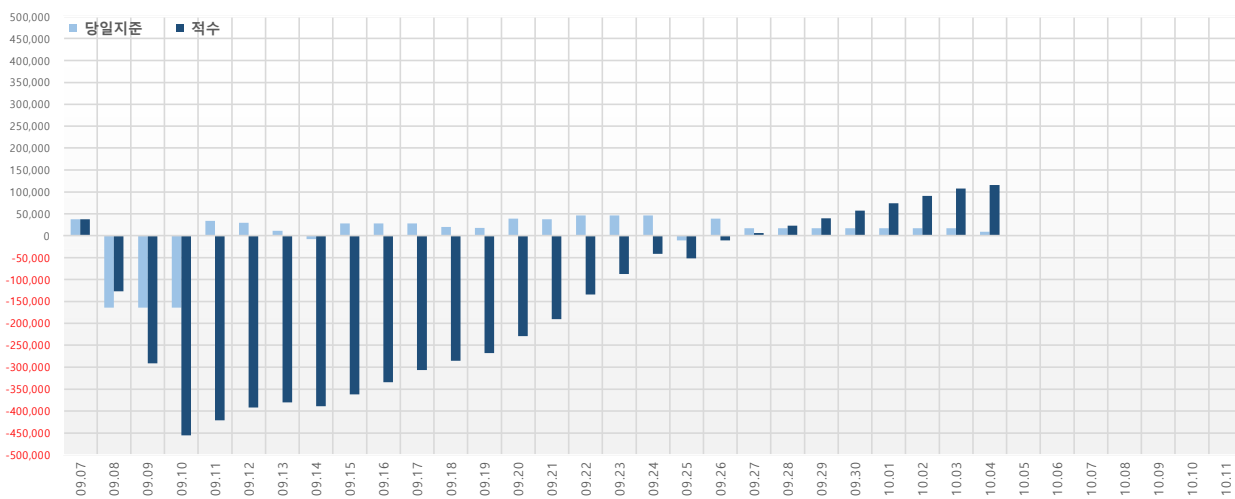


| 기준금리 추이 | | | 단위 : %P |
|----------|---------------|----------|---------------|
| 2023년 | 2022년 | 2021년 | |
| 11.30(목) | - | 11.24(목) | 3.25% (▲0.25) |
| 10.19(목) | - | 10.12(수) | 3.00% (▲0.50) |
| 08.24(목) | 3.50% (동결) | 08.25(목) | 2.50% (▲0.25) |
| 07.13(목) | 3.50% (동결) | 07.13(수) | 2.25% (▲0.50) |
| 05.25(목) | 3.50% (동결) | 05.26(목) | 1.75% (▲0.25) |
| 04.11(화) | 3.50% (동결) | 04.14(목) | 1.50% (▲0.25) |
| 02.23(목) | 3.50% (동결) | 02.24(목) | 1.25% (동결) |
| 01.13(금) | 3.50% (▲0.25) | 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) | 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) | -8,230 | -388,727 |
| 09.15(금) | 27,667 | -361,648 |
| 09.23(토) | 46,457 | -87,924 |
| 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) | 37,481 | -190,244 |
| 09.22(금) | 46,457 | -134,381 |
| 09.23(토) | 46,457 | -87,924 |
| 09.24(일) | 46,457 | -41,467 |
| 09.25(월) | -10,750 | -51,847 |
| 09.26(화) | 39,354 | -10,650 |
| 09.27(수) | 16,885 | 6,236 |
| 09.28(목) | 16,885 | 23,121 |
| 09.29(금) | 16,885 | 40,006 |
| 09.30(토) | 16,885 | 56,891 |
| 10.01(일) | 16,885 | 73,776 |
| 10.02(월) | 16,885 | 90,661 |
| 10.03(화) | 16,885 | 107,546 |
| 10.04(수) | 9,106 | 115,978 |
| 10.06(금) | | |
| 10.07(토) | | |
| 10.08(일) | | |
| 10.09(월) | | |
| 10.10(화) | | |
| 10.11(수) | | |