

레포 시장동향

◎ 전일

대규모 국고 및 공자기금 유입되어 운용사 및 신탁 유동성 호전되었으며, 장중 매수 추가됨에 따라 익일물 및 기일물 조달금리 크게 하락하였음.

◎ 금일

국고여유자금 추가 유입되어 잉여세 심화되었음. 월말세입에 따른 자금 이동 예상되나 차주 기준 마감 앞두고 은행권 조달에 신중할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.10.05 (목)				2023.10.06 (금)					
한은RP매각 만기(14일)		10,000		국고여유자금			73,000		
금융중개지원대출		5,000		재정 [국세환급1.9 실시간1.4]			33,000		
재정증권 만기(63일)		15,000		자금조정예금 만기			3,000		
공자기금		21,000							
국고여유자금		46,000							
재정 [국방부0.8 국세환급0.7 실시간0.4]		19,000							
자금조정예금 만기		5,000							
기타		3,000							
한은RP매각(7일)		-30,000		월말세입			-106,000		
통안채 발행(2년), 낙찰수익률 4.020%		-18,600		자금조정예금			-3,000		
국고채 발행(30년)		-21,000							
월말세입		-63,000							
자금조정예금		-3,000							
전일 기준	지준	-2,246	적수	113,732	금일 예상	지준	-2,000	적수	111,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.09.25(월)	183.5	175.2	3.60%	3.630%	3.622%	3.500%	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	169.5	3.60%	3.555%	3.620%		3.84%	4.108%	4.203%
2023.10.05(목)	172.9		3.50%	3.527%	3.535%		3.83%	4.081%	4.180%

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
2023.10.05(목)	14:00~14:10	7	2023.10.12(목)	41.80	3.50%	3.00	7.2%	2023-053-007

◎ 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	2차전자 부품 제조 기업	2023.10.10(화) ~ 2023.10.11(수)	2023.10.13(금)	미래

관련 정보

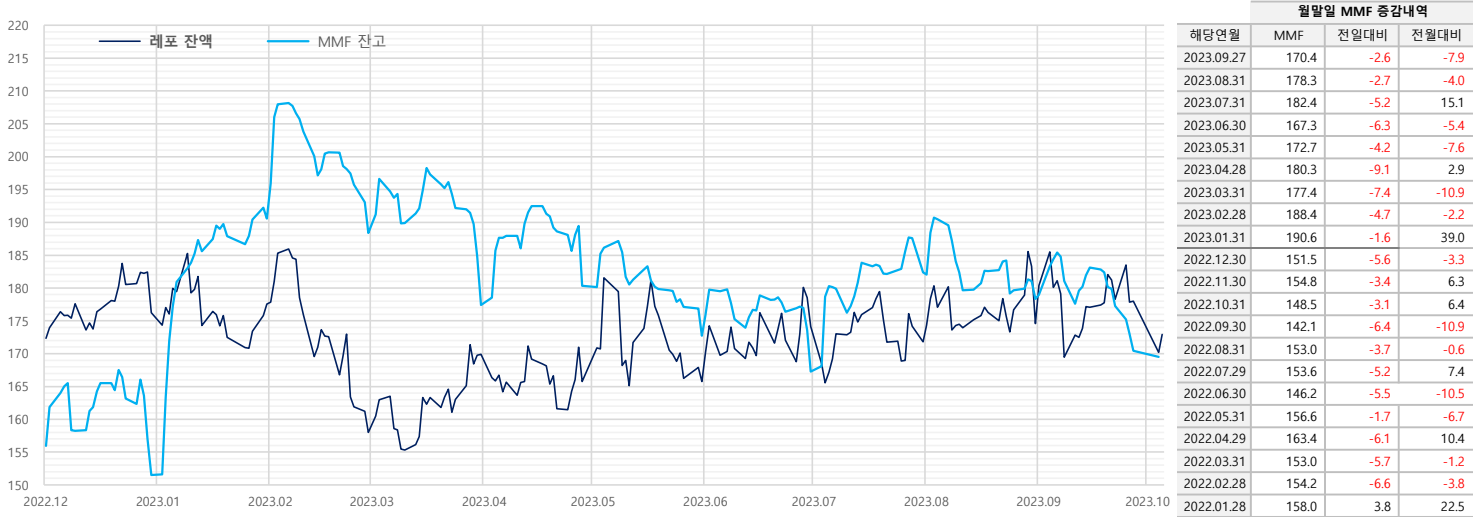
지준일	2023.10.11(수)	금통위	2023.10.19(목)	FOMC	2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr	
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr	
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttId=10078655&menuNo=200690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

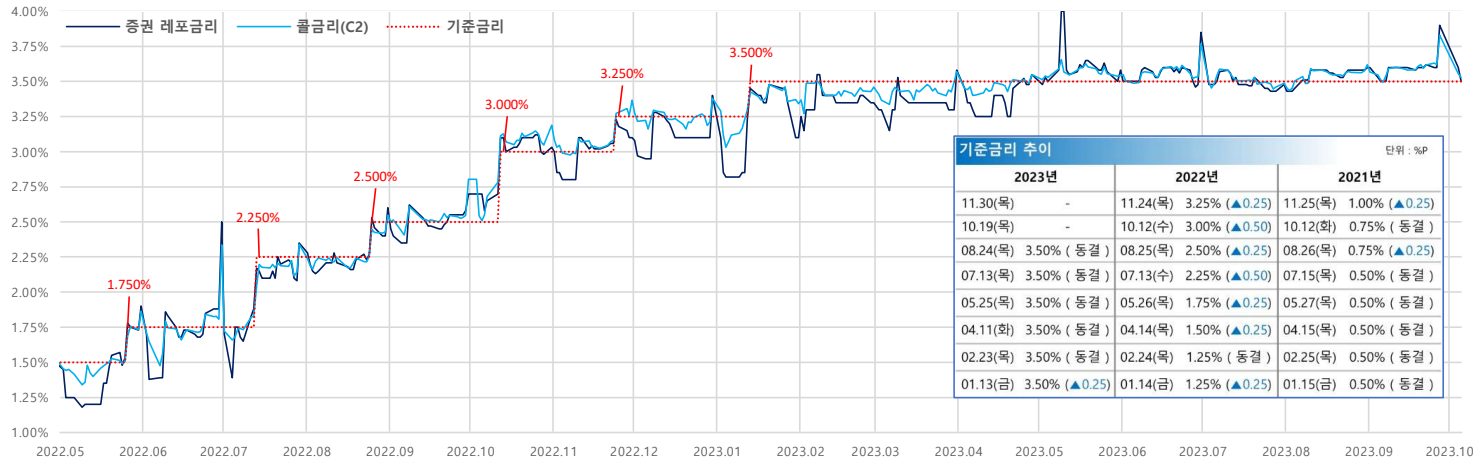
레포 거래잔액 및 MMF 잔고 추이

단위 : 조 원



자료 : 금융투자협회, 예탁결제원

단기금융시장 금리 추이



자료 : 한국은행

당일기준 및 적수 추이

단위 : 억 원

