

## 레포 시장동향

### ◎ 전주

월초 MMF 설정 및 대규모 국고금 유입 영향으로 조달여건 크게 개선되었으며, 주중 잉여세 심화되어 시은 및 증권 저금리 매도 활발하였음. 주 후반부로 갈수록 익일물 및 기일물 금리 급락했고, 기준 마감이 가까워짐에 따라 은행권 운용 및 조달에 점차 신중한 모습을 보임.

### ◎ 금일

자금 이탈요인 많지 않아 잉여 분위기 유지되었으나, 기준일 전 적수 관리를 위한 은행권 움직임 있겠으나 거래 제한적일 전망.

## 기준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.10.06 (금)				2023.10.10 (화)			
국고여유자금		70,000		통안계정 만기(28일)			5,000
재정 [국세환급1.9   실시간1.5]		34,000		통안채 만기(91일)			7,000
자금조정예금 만기		3,000		공자기금			1,000
기타		1,000		재정 [국방부0.5   국세환급0.7   실시간0.8]			20,000
				자금조정예금 만기			5,000
월말세입		-106,000		통안채 발행(91일)			-10,000
자금조정예금		-5,000		국고채 비경쟁인수			-1,000
				국고여유자금 환수			-26,000
				세입			-6,000
				자금조정예금			-5,000
<b>전일 기준</b>	<b>기준</b>	<b>-4,918</b>	<b>적수</b>	<b>108,784</b>	<b>금일 예상</b>	<b>기준</b>	<b>-15,000</b>
						<b>적수</b>	<b>79,000</b>

## Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.09.26(화)	177.8	173.1	3.60%	3.620%	3.672%	3.500%	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	176.3	3.50%	3.527%	3.535%		3.83%	4.081%	4.180%
2023.10.06(금)	173.1		3.43%	3.502%	3.471%		3.82%	4.015%	4.105%

## 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	주지사 / 인수사 (증거금)
공모주	퓨릿	반도체 소재 기업	2023.10.05(목) ~ 2023.10.06(금)	2023.10.11(수)	미래 (7.83조)
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

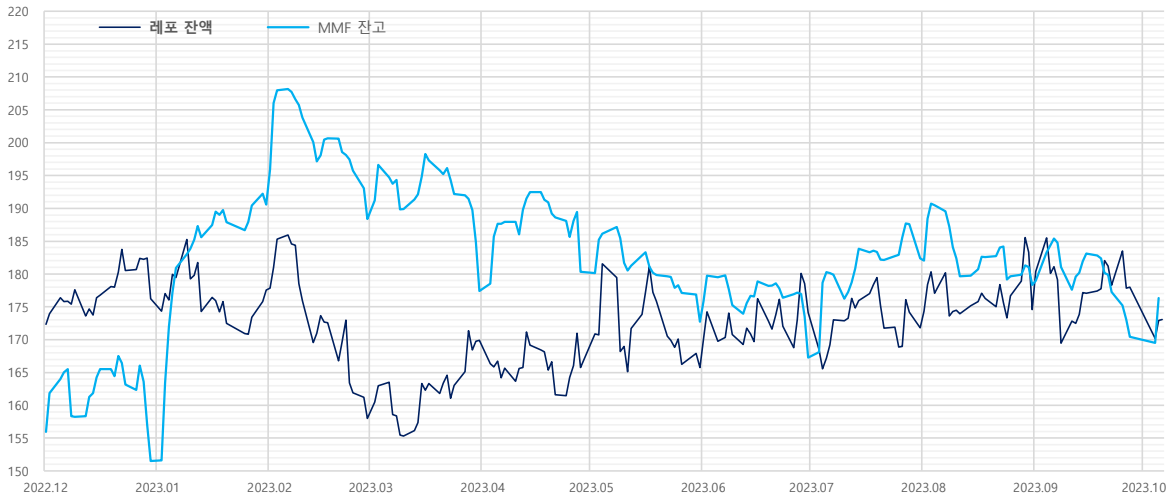
기준일	2023.10.11(수)	금통위	2023.10.19(목)	FOMC	2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수)	한국은행	<a href="http://www.bok.or.kr">http://www.bok.or.kr</a>
· 금융감독원, RP거래 최소증거금률 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장   자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	<a href="https://ecos.bok.or.kr">https://ecos.bok.or.kr</a>
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						무위험지표금리	<a href="https://www.kofr.kr">https://www.kofr.kr</a>
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						증권정보포털	<a href="https://seibro.or.kr">https://seibro.or.kr</a>
· 2023년 기준 계산·적립기간 및 금통위						금융투자협회	<a href="https://kofiabond.or.kr">https://kofiabond.or.kr</a>

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

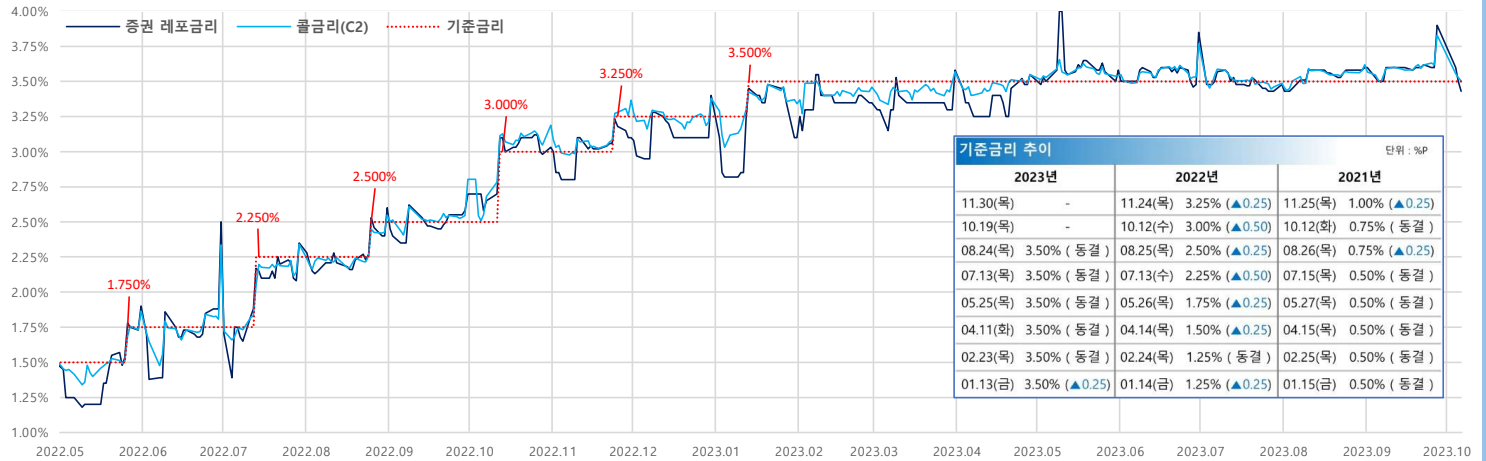
단위 : 조 원



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

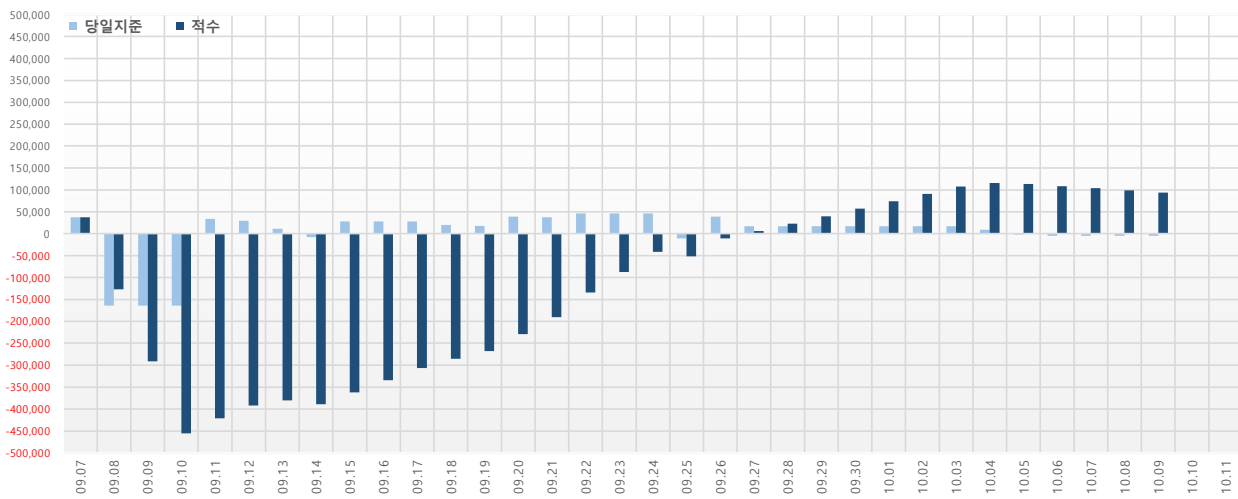


기준금리 추이			단위 : %P
2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	1.75% (▲0.25)
04.11(화)	3.50% (동결)	04.14(목)	1.50% (▲0.25)
02.23(목)	3.50% (동결)	02.24(목)	1.25% (동결)
01.13(금)	3.50% (▲0.25)	01.14(금)	1.25% (▲0.25)
		01.15(금)	0.50% (동결)
		02.25(목)	0.50% (동결)
		03.26(목)	0.50% (동결)
		04.15(목)	0.50% (동결)
		05.27(목)	0.50% (동결)
		08.26(목)	0.75% (▲0.25)
		10.12(화)	0.75% (동결)
		11.25(목)	1.00% (▲0.25)

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)	-8,250	-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
10.05(목)	-2,246	113,732
10.06(금)	-4,918	108,784
10.07(토)	-4,918	103,866
10.08(일)	-4,918	98,948
10.09(월)	-4,918	94,030
10.10(화)		
10.11(수)		