

레포 시장동향

◎ 전주

주초 잉여 마감 우려 증대되어 은행권 운용에 적극적이었으며, 한은 비정례 통안계정 실시하여 유동성 추가 흡수하였음.
지준 마감 직후 대규모 국고금 유입되어 잉여세 지속되었고, 장중 조달금리 하락함에 따라 시은 저금리 매도 증가하였음.
주말 전 청약환불 및 국고여유자금 환수 영향으로 레포금리 상승 출발했으나 기 유입된 유동성 풍부하여 수급 무난하였음.

◎ 금일

국고금 유출입 혼재하나 건보자금 운용 예정되어 있어 조달여건 양호하겠으며, 적립월 초반 은행권 조달 제한적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.10.13 (금)				2023.10.16 (월)					
재정 [교육부4.1 복지부0.7 국세환급0.1 실시간0.8]		57,000		공자기금		8,000			
자금조정예금		5,000		재정 [복지부0.8 국세환급0.1 실시간0.6]		15,000			
기타		5,000		자금조정예금 만기		4,000			
국고여유자금 환수		-48,000		국고여유자금 환수		-10,000			
제기금 환수		-2,000		국고채 발행(50년)		-8,000			
세입		-5,000		세입		-5,000			
자금조정예금		-4,000		자금조정예금		-4,000			
전일 기준	지준	15,488	적수	25,952	금일 예상	지준	15,000	적수	72,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.10.06(금)	173.1	179.8	3.43%	3.502%	3.471%	3.500%	3.82%	4.015%	4.105%
2023.10.10(화)	173.0	181.1	3.40%	3.471%	3.467%		3.82%	3.997%	4.087%
2023.10.11(수)	173.3	181.1	3.40%	3.473%	3.467%		3.82%	3.953%	4.039%
2023.10.12(목)	179.4	180.8	3.43%	3.512%	3.460%		3.82%	3.932%	4.004%
2023.10.13(금)	174.5		3.53%	3.542%	3.551%		3.82%	3.957%	4.036%

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
2023.10.12(목)	14:00~14:10	7	2023.10.19(목)	64.20	3.50%	1.00	1.6%	2023-054-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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	위트	반도체 공정환경제어 장비 기업	2023.10.16(월) ~ 2023.10.17(화)	2023.10.19(목)	키움
실권주	피플바이오	바이오 제품 개발 기업	2023.10.16(월) ~ 2023.10.17(화)	2023.10.19(목)	한투
실권주	레몬	나노소재 전문 기업	2023.10.16(월) ~ 2023.10.17(화)	2023.10.19(목)	현대차
공모주	퀵리타스반도체	반도체 설계자산(IP) 전문 기업	2023.10.18(수) ~ 2023.10.19(목)	2023.10.23(월)	한투

관련 정보

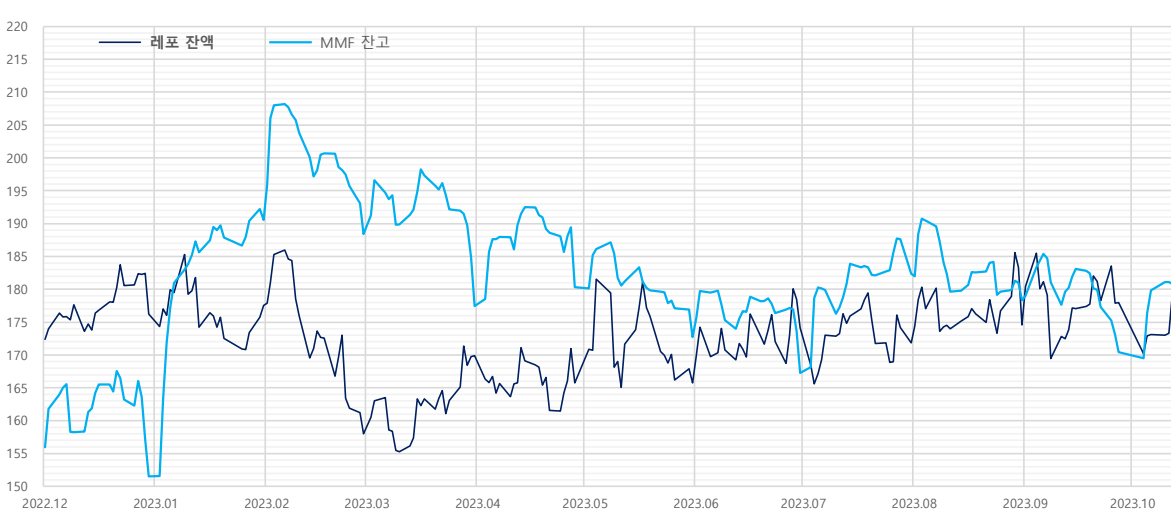
기준일	2023.11.08(수)	금통위	2023.10.19(목)	FOMC	2023.10.31(화) ~ 2023.11.01(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 금융감독원, RP거래 최소증거금을 가이드라인 2023.09.01.부터 2024.08.31.까지 1년 간 연장 자본시장법 시행령 제181조제3항제1호						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)						우위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						증권정보포털	https://seibro.or.kr
· 2023년 기준 계산·적립기간 및 금통위						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)	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

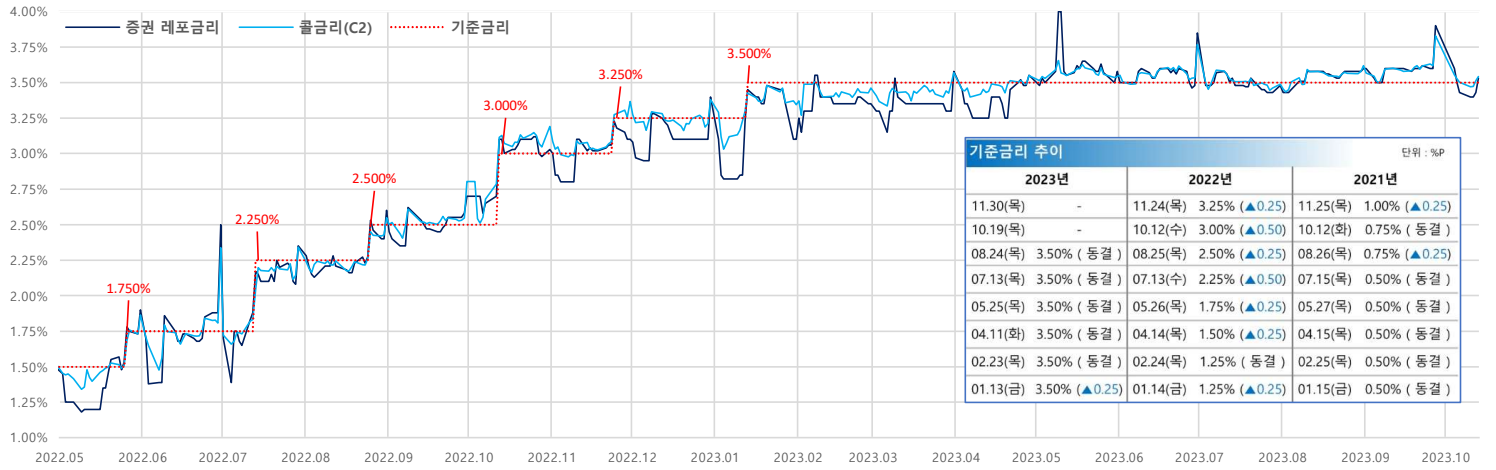
단위 : 조 원



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

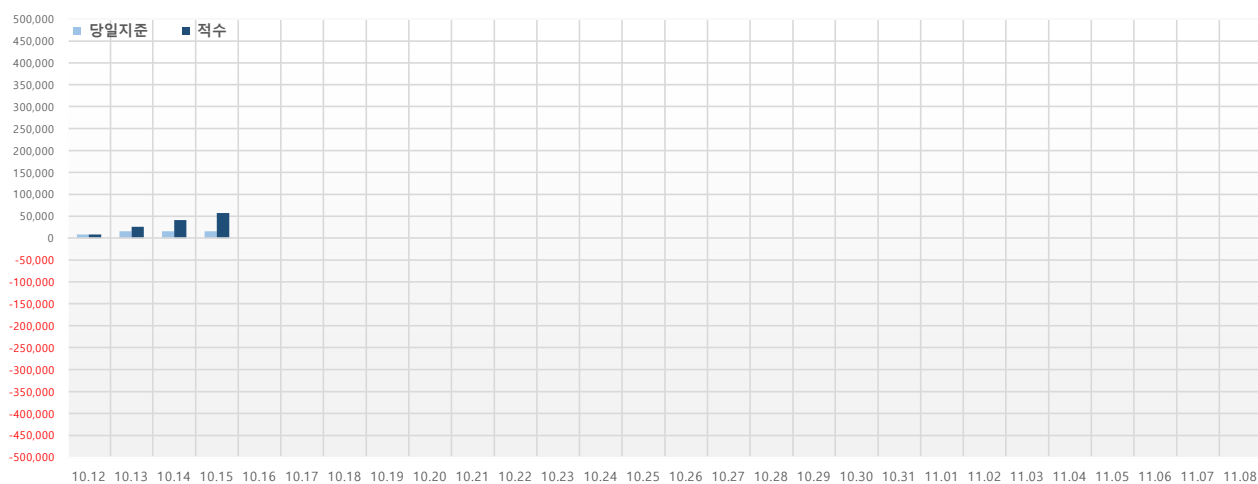


기준금리 추이			단위 : %P
2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)
08.24(목)	3.50% (동결)	08.25(목)	2.50% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	1.75% (▲0.25)
04.11(화)	3.50% (동결)	04.14(목)	1.50% (▲0.25)
02.23(목)	3.50% (동결)	02.24(목)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

자료 : 한국은행

당일지준 및 적수 추이

단위 : 억 원



	당일지준	적수
10.12(목)	7,733	7,733
10.13(금)	15,488	25,952
10.14(토)	15,488	41,440
10.15(일)	15,488	56,928
10.16(월)		
10.17(화)		
10.18(수)		
10.19(목)		
10.20(금)		
10.21(토)		
10.22(일)		
10.23(월)		
10.24(화)		
10.25(수)		
10.26(목)		
10.27(금)		
10.28(토)		
10.29(일)		
10.30(월)		
10.31(화)		
11.01(수)		
11.02(목)		
11.03(금)		
11.04(토)		
11.05(일)		
11.06(월)		
11.07(화)		
11.08(수)		