

레포 시장동향

◎ 전주

주초 MMF 환매 대기자금 운용 기대됐으나 시은 및 증권 매도 또한 증가하여 시장 다소 빠듯한 모습을 보임.
 월말일 자금경색 우려로 금리 상승하자 장중 매수자금 유입 이어졌으며, 당초 우려와 달리 수급 무난하였음.
 월말 직후 유동성 회복되어 금리 재하락 했고, 통안채 만기와 국고금 유입 겹쳐 조달여건 크게 개선되었음.

◎ 금일

유동성 매우 풍부하나 지준 마감 앞두고 운용사 및 신탁 3일물 운용 제한적이겠으며, 기일별 조달여건 상이할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.06.02 (금)				2023.06.05 (월)					
통안채 만기(2년)		91,100		통안채 만기(91일)		11,100			
금융중개지원대출		11,000		국고여유자금		2,000			
공자기금		3,000		재정 [국세환급1.0 실시간0.6]		16,000			
국고여유자금		117,000		자금조정예금 만기		39,000			
재정 [국세환급0.5 실시간0.7]		12,000							
자금조정예금 만기		36,000		통안채 발행(91일)		-13,000			
국고채 비경쟁인수		-3,000		국고채 비경쟁인수		-1,000			
월말세입		-132,000		공자기금		-14,000			
자금조정예금		-39,000		세입		-4,000			
기타		-1,000		자금조정예금		-36,000			
전일 기준	지준	3,219	적수	10,870	금일 예상	지준	3,000	적수	20,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.05.26(금)	166.2	177.1	3.57%	3.557%	3.582%	3.500%	3.75%	3.524%	3.550%
2023.05.30(화)	167.9	176.9	3.50%	3.537%	3.529%		3.76%	3.560%	3.582%
2023.05.31(수)	165.8	172.7	3.58%	3.543%	3.595%		3.76%	3.459%	3.450%
2023.06.01(목)	170.0	175.8	3.50%	3.550%	3.528%		3.76%	3.478%	3.464%
2023.06.02(금)	174.2		3.50%	3.504%	3.522%		3.76%	3.436%	3.405%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2023.05.25(목)	3.50% (동 결)	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)
2023.04.11(화)	3.50% (동 결)	2022.11.24(목)	3.25% (▲0.25)	2022.07.13(수)	2.25% (▲0.50)	2022.02.24(목)	1.25% (동 결)	2021.08.26(목)	0.75% (▲0.25)
2023.02.23(목)	3.50% (동 결)	2022.10.12(수)	3.00% (▲0.50)	2022.05.26(목)	1.75% (▲0.25)	2022.01.14(금)	1.25% (▲0.25)	2020.05.28(목)	0.50% (▼0.25)

한국은행 공개시장운영 잔액

◎ RP매입 채안펀드 출자 금융기관 유동성 지원

단위 : 억 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	매입금리	낙찰금액	회차번호
2023.04.28(금)	14:00~14:10	91	2023.07.28(금)	-	155	3.50%	155	2023-026-091

◎ RP매각

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.06.01(목)	14:00~14:10	7	2023.06.08(목)	14.09	3.50%	14.00	99.4%	2023-032-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2023.05.16(화)	14:00~14:10	28	2023.06.13(화)	2.00	3.75	3.49%	2.30	2023-0018-0028
2023.05.23(화)	14:00~14:10	28	2023.06.20(화)	3.00	3.80	3.52%	3.60	2023-0019-0028
2023.05.30(화)	14:00~14:10	28	2023.06.27(화)	3.00	1.70	3.52%	1.60	2023-0020-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	큐라티스	백신 및 면역질환 전문기업	2023.06.05(월) ~ 2023.06.07(수)	2023.06.09(금)	대신 / 신영
공모주	프로테옴텍	체외진단 의료기 전문기업	2023.06.07(수) ~ 2023.06.08(목)	2023.06.12(월)	키움

관련 정보

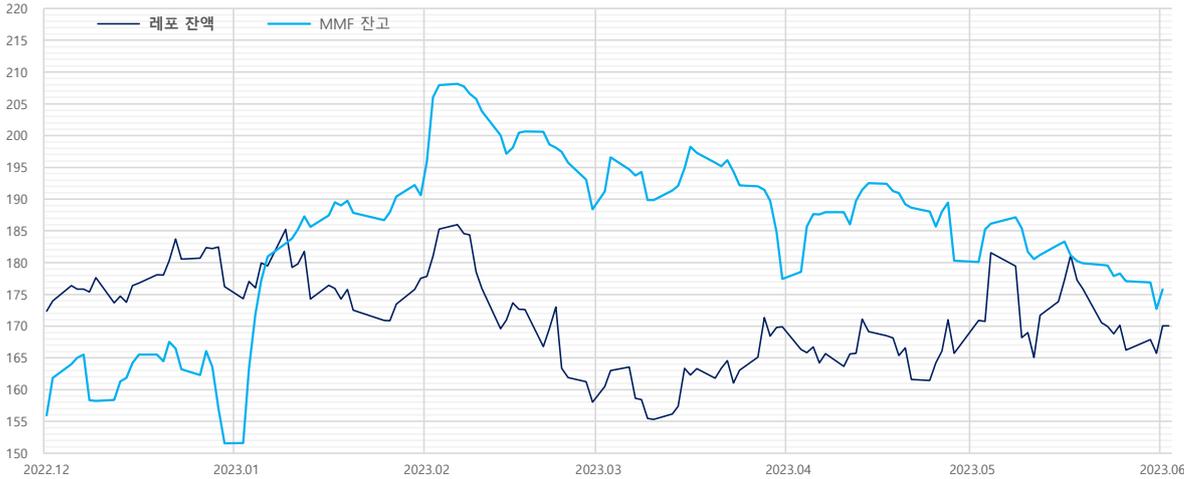
지준일	2023.06.07(수)	금통위	2023.07.13(목)	FOMC	2023.06.13(화) ~ 2023.06.14(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
한국은행, 단기금융시장 안정화 조치 연장 시행 (2023.01.13)						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
한국은행, 최근 단기금융 및 채권 시장 불안과 한국은행의 시장안정화 조치 (2022.12.2)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						증권정보포털	https://seibro.or.kr
2023년 지준 계산적립기간 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)	04.25(화)		07.25(화) ~ 07.26(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)		09.14(목)	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	월일별 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	전월대비
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

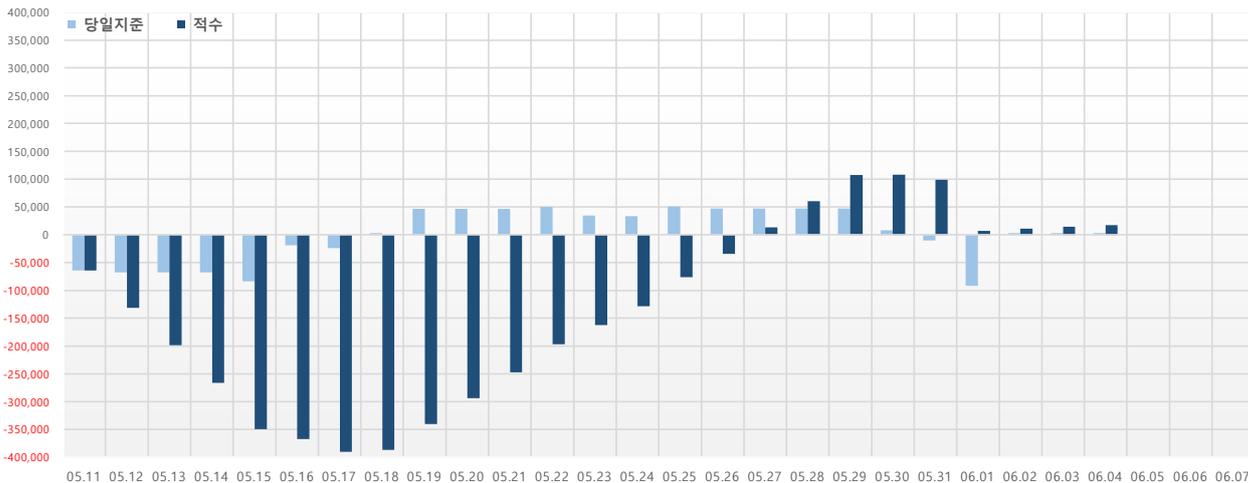


기준금리 추이				단위 : %P	
2023년	2022년	2021년			
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	-	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	-	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	1.75% (▲0.25)	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
05.11(목)	-63,891	-63,891
05.12(금)	-67,393	-131,284
05.13(토)	-67,393	-198,677
05.14(일)	-67,393	-266,070
05.15(월)	-83,174	-349,350
05.16(화)	-18,859	-366,814
05.17(수)	-23,967	-390,345
05.18(목)	3,245	-387,092
05.19(금)	46,752	-340,332
05.20(토)	46,752	-293,580
05.21(일)	46,752	-246,828
05.22(월)	49,994	-196,841
05.23(화)	34,508	-162,329
05.24(수)	33,135	-128,641
05.25(목)	50,662	-76,459
05.26(금)	47,090	-33,926
05.27(토)	47,090	13,164
05.28(일)	47,090	60,254
05.29(월)	47,090	107,344
05.30(화)	8,405	108,042
05.31(수)	-10,065	98,834
06.01(목)	-91,882	6,819
06.02(금)	3,219	10,870
06.03(토)	3,219	14,089
06.04(일)	3,219	17,308
06.05(월)		
06.06(화)		
06.07(수)		