

레포 시장동향

◎ 전일

지준일 전일자 롤오버를 제외한 신규거래 제한적이었으며, 은행 간 콜 조정 후 소폭 잉여 마감함.

◎ 금일

국고채 만기에 앞서 대규모 공자 및 국고 환수 선행되겠으며, 조달여건 크게 악화되어 은행권 매수 의존도 증대될 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.06.07 (수)				2023.06.08 (목)					
재정 [군급여1.1 국세환급0.7 실시간0.6]		24,000		한은RP매각 만기(7일)		140,000			
자금조정예금 만기		38,000		통안채 만기(28일)		11,400			
				재정증권 만기(63일)		10,000			
				재정 [방사형0.5 국세환급0.5 실시간1.2]		22,000			
				자금조정예금 만기		36,000			
국고여유자금 환수	-6,000			한은RP매각(7일)		-90,000			
세입	-27,000			통안채 발행(2년)		-22,000			
자금조정예금	-36,000			국고채 발행(3년)		-26,000			
				국고채 발행(2년)		-17,000			
				재정증권 발행(63일)		-15,000			
				공자기금 환수 [공자 환수 -20.5 공자예탁금 환수 -17.5 공자 지출 15.2]		-228,000			
				국고여유자금 환수		-17,000			
				세입		-10,000			
				자금조정예금		-36,000			
				요지준 변동		-3,000			
전일 기준	지준	-9,037	적수	1,223	금일 예상	지준	-243,000	적수	-243,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.05.31(수)	165.8	172.7	3.58%	3.543%	3.595%	3.500%	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	179.7	3.50%	3.504%	3.522%		3.76%	3.436%	3.405%
2023.06.05(월)	169.8	179.5	3.50%	3.487%	3.530%		3.76%	3.502%	3.489%
2023.06.07(수)	170.3		3.50%	3.491%	3.530%		3.75%	3.471%	3.449%

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

◎ 통화안정결제예치금

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	2023.07.05(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)						www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttId=10074981&menuNo=200690	경제통계시스템 https://ecos.bok.or.kr
한국은행, 최근 단기금융 및 채권 시장 불안과 한국은행의 시장안정화 조치 (2022.12.26)						www.bok.or.kr/portal/bbs/B0000347/view.do?nttId=10074403&menuNo=201106	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

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

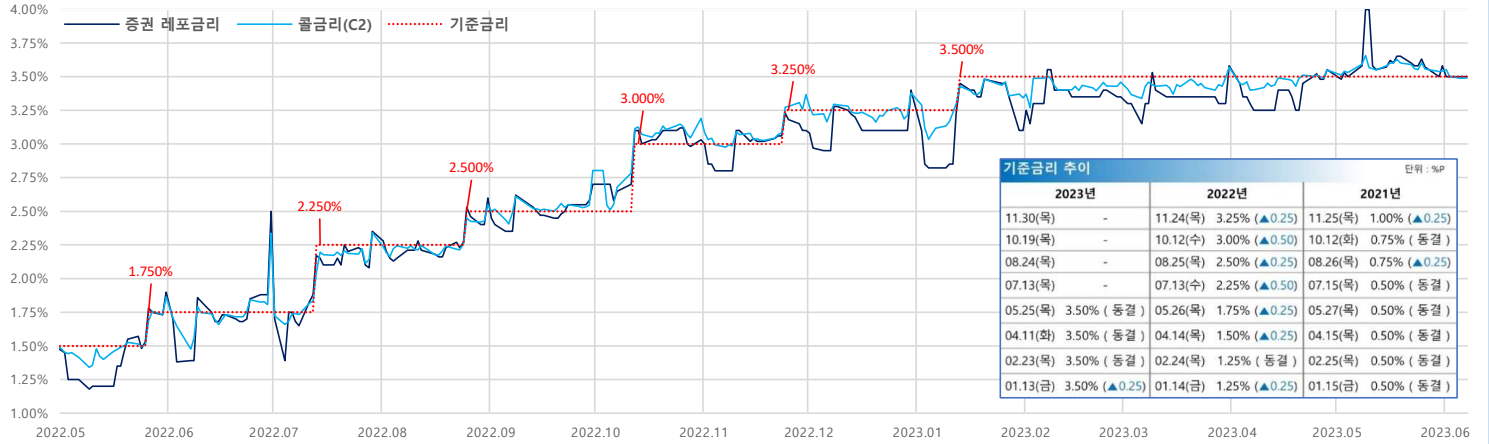
단위 : 조 원



해당연월	월일별 MMF 증감내역		
	MMF	전월대비	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

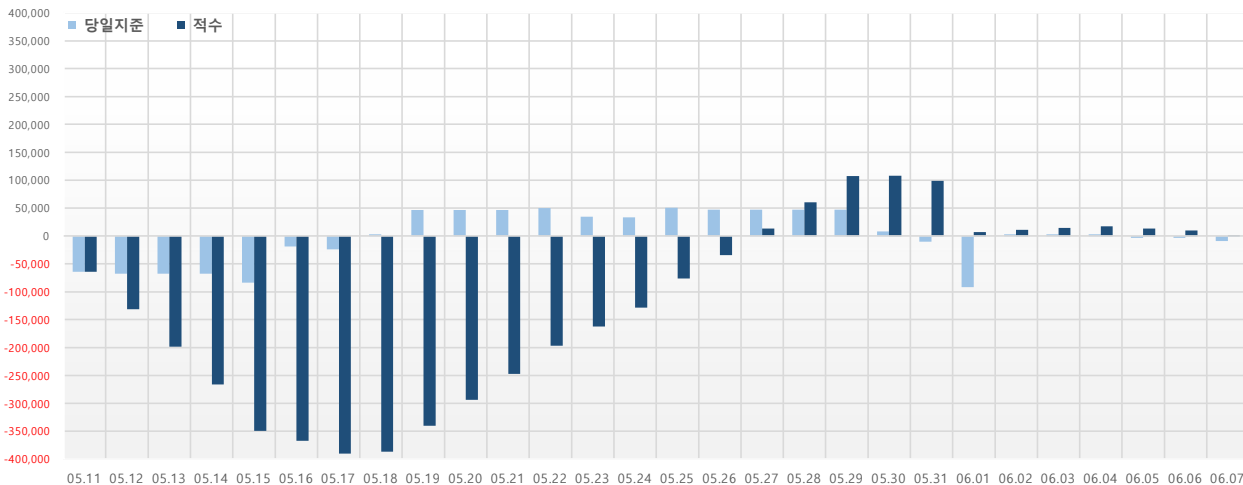


기준금리 추이				단위 : %P
	2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	-	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)	
10.19(목)	-	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)	
08.24(목)	-	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)	
07.13(목)	-	07.13(수) 2.25% (▲0.50)	07.15(목) 0.50% (동결)	
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목) 1.75% (▲0.25)	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)	-3,304	13,545
06.06(화)	-3,304	10,241
06.07(수)	-9,037	1,223