

Repo Market Report

2023.06.26 (월)



자금시장부 6021-5832

레포 시장동향

◎ 전주

적수 관리를 위한 시은 조달 꾸준한 가운데 공모주 청약 흥행으로 증권사 매도 증가하여 수급 타이트한 모습을 보임. 건보자금 이달함에 따라 청약자금 운용 효과 제한적이었고, 분기말 대비 기일물 탐색 이어졌으나 매칭 쉽지 않았음. 주말 전 부족세 심화되어 은행권 매수 의존도 증대됐으며, 장중 조달금리 상승하는 등 난항 속에 힘겹게 마감하였음.

◎ 금일

적수 상황 호전되어 시은 매도 감소 예상되나 그 외 유동성 개선요인 없어 은행권 움직임에 따라 분위기 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.06.23 (금)				2023.06.26 (월)			
재정 [국채환급0.2 실시간2.5]		27,000		재정 [국채환급0.4 실시간2.3]		27,000	
자금조정예금 만기		36,000		자금조정예금 만기		36,000	
공자기금 환수		-8,000		공자기금 환수		-10,000	
세입		-4,000		통안채 발행(2년)		-10,000	
자금조정예금		-36,000		통안채 발행(1년)		-1,000	
				세입		-4,000	
				자금조정예금		-36,000	
전일 기준	지준	28,837	적수	금일 예상	지준	31,000	적수
							-157,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.06.19(월)	172.8	178.2	3.60%	3.605%	3.610%	3.500%	3.75%	3.583%	3.593%
2023.06.20(화)	171.6	178.2	3.57%	3.591%	3.586%		3.75%	3.567%	3.579%
2023.06.21(수)	173.8	178.6	3.59%	3.605%	3.604%		3.75%	3.571%	3.581%
2023.06.22(목)	176.1	177.8	3.56%	3.578%	3.580%		3.75%	3.592%	3.598%
2023.06.23(금)	172.0		3.60%	3.617%	3.619%		3.75%	3.609%	3.617%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

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)
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)	2021.08.26(목) 0.75% (▲0.25)
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)	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
2023.06.22(목)	14:00~14:10	7	2023.06.29(목)	14.03	3.50%	14.03	100.0%	2023-035-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2023.05.30(화)	14:00~14:10	28	2023.06.27(화)	3.00	1.70	3.52%	1.60	2023-0020-0028
2023.06.13(화)	14:00~14:10	28	2023.07.11(화)	3.50	3.88	3.52%	3.88	2023-0021-0028
2023.06.20(화)	14:00~14:10	28	2023.07.18(화)	2.50	2.75	3.52%	2.75	2023-0022-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주관사 / 인수사 (증거금)
공모주	오픈놀	커리어-채용 플랫폼 기업	2023.06.21(수) ~ 2023.06.22(목)	2023.06.26(월)	하나 (0.1조)
공모주	교보14호스팩	기업인수목적회사	2023.06.26(월) ~ 2023.06.27(화)	2023.06.29(목)	교보
실권주	셀바스AI	음성인식 전문기업	2023.06.26(월) ~ 2023.06.27(화)	2023.06.29(목)	KB
실권주	KEC	반도체 부품 제조기업	2023.06.26(월) ~ 2023.06.27(화)	2023.06.29(목)	KB
공모주	이노시물레이선	확장현실(XR) 솔루션 전문기업	2023.06.27(화) ~ 2023.06.28(수)	2023.06.30(금)	하나

관련 정보

지준일	2023.07.05(수)	금통위	2023.07.13(목)	FOMC	2023.07.25(화) ~ 2023.07.26(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
한국은행, 최근 단기금융 및 채권 시장 불안과 한국은행의 시장안정화 조치 (2022.12.26)						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
한국은행, 통화안정증권 정례입찰 운영방식 개선 (2023.06.22)						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)						증권정보포털	https://seibro.or.kr
2023년 지준 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)	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

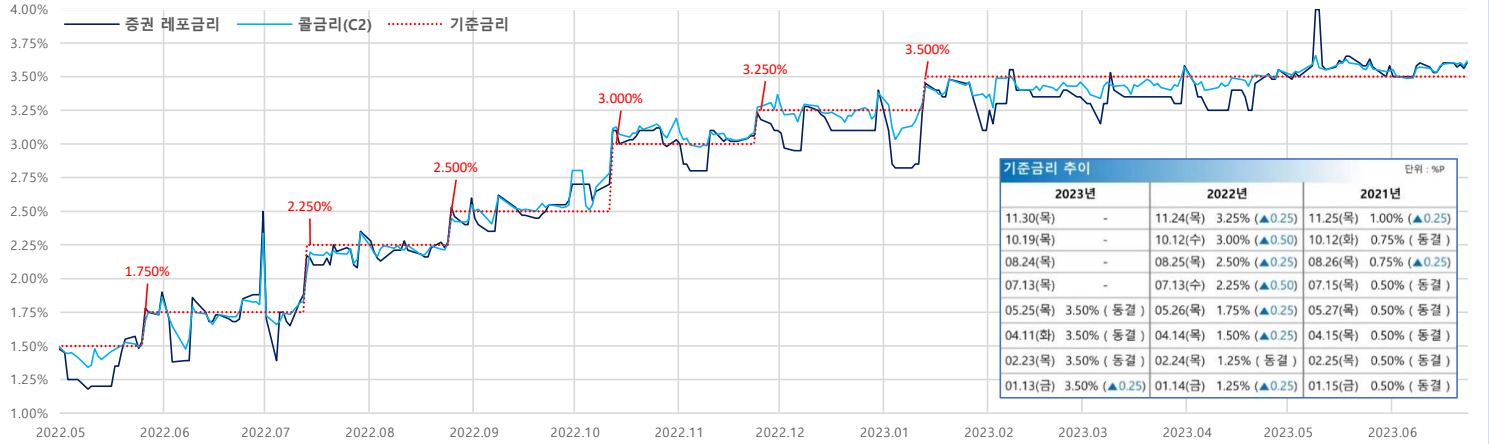
단위 : 조 원



해당연월	월말일 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

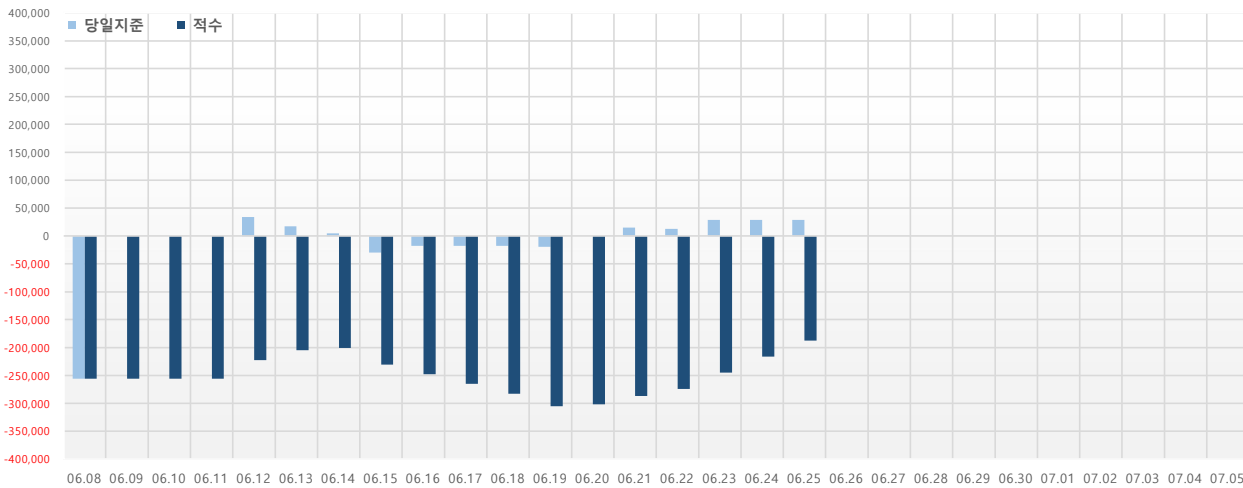


기준금리 추이				단위 : %P	
2023년	2022년	2021년			
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	-	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	-	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	1.75% (▲0.25)	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
06.08(목)	-255,769	-255,769
06.09(금)	-28	-255,810
06.10(토)	-28	-255,838
06.11(일)	-28	-255,866
06.12(월)	33,691	-222,213
06.13(화)	17,323	-204,893
06.14(수)	4,404	-200,489
06.15(목)	-30,072	-230,558
06.16(금)	-17,400	-247,960
06.17(토)	-17,400	-265,360
06.18(일)	-17,400	-282,760
06.19(월)	-19,194	-305,132
06.20(화)	-634	-301,973
06.21(수)	14,984	-286,991
06.22(목)	12,901	-274,083
06.23(금)	28,837	-245,245
06.24(토)	28,837	-216,408
06.25(일)	28,837	-187,571
06.26(월)		
06.27(화)		
06.28(수)		
06.29(목)		
06.30(금)		
07.01(토)		
07.02(일)		
07.03(월)		
07.04(화)		
07.05(수)		