

Repo Market Report

2023.06.30 (금)



자금시장부 6021-5832

레포 시장동향

- ◎ 전일
통안계정 만기 규모 상당하여 시은 조달 감소했으며, 공모주 청약자금 운용되어 조달여건 대체로 양호하였음.
- ◎ 금일
반기말 MMF 환매 및 청약 환불 영향으로 부족세 강할 전망. 은행권 매수 의존도 증대되었을며, 회사채 정체 예상됨.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.06.29 (목)				2023.06.30 (금)				
한은RP매각 만기(7일)		140,300		공자기금			9,000	
통안계정 만기(2일)		95,000		재정 [국세환급0.1 실시간3.1]			32,000	
재정증권 만기(63일)		10,000		자금조정예금 만기			37,000	
재정 [국토부0.7 국세환급0.3 실시간2.0]		30,000						
자금조정예금 만기		38,000						
한은RP매각(7일)		-160,000		국고채 비경쟁인수			-10,000	
재정증권 발행(63일)		-15,000		국고여유자금 환수			-1,000	
세입		-12,000		세입			-13,000	
자금조정예금		-37,000		자금조정예금			-37,000	
전일 기준	지준	72,214	적수	금일 예상	지준	89,000	적수	-63,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.06.23(금)	172.0	176.4	3.60%	3.617%	3.619%		3.75%	3.609%	3.617%
2023.06.26(월)	168.8	176.9	3.58%	3.559%	3.600%		3.75%	3.568%	3.576%
2023.06.27(화)	173.0	177.2	3.50%	3.520%	3.532%	3.500%	3.75%	3.538%	3.565%
2023.06.28(수)	180.1	177.0	3.46%	3.531%	3.501%		3.75%	3.557%	3.574%
2023.06.29(목)	178.5		3.48%	3.534%	3.523%		3.75%	3.584%	3.589%

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
2023.06.29(목)	14:00~14:10	7	2023.07.06(목)	17.90	3.50%	16.00	89.4%	2023-036-007

◎ 통화안정예금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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
2023.06.27(화)	14:00~14:10	28	2023.07.25(화)	3.00	3.75	3.50%	3.25	2023-0023-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	이노시물레이션	확장현실(XR) 솔루션 전문기업	2023.06.27(화) ~ 2023.06.28(수)	2023.06.30(금)	하나 (3.57조)
BW	엠에프엠코리아	의류 제조기업	2023.06.27(화) ~ 2023.06.28(수)	2023.06.30(금)	KB (0.55조)

관련 정보

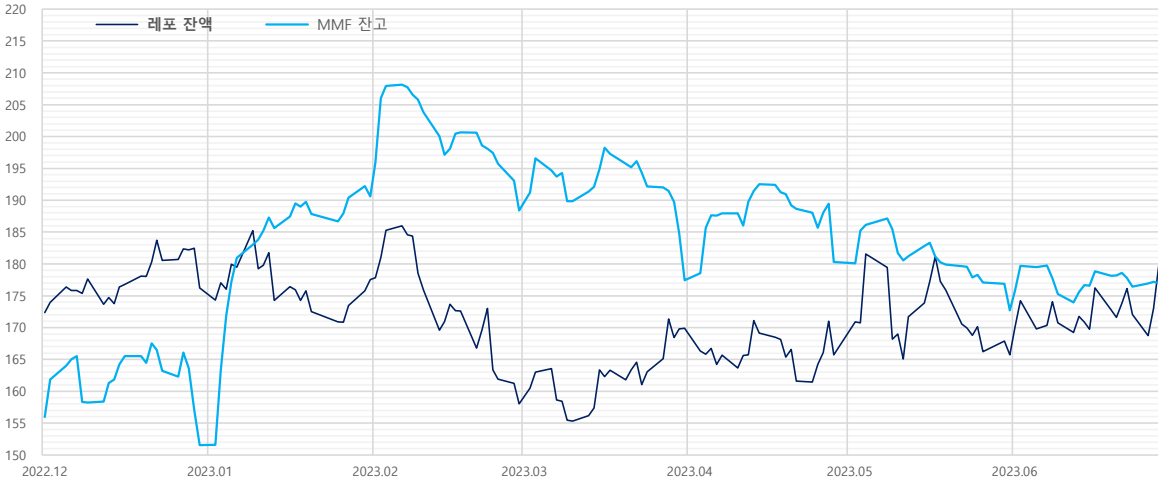
지준일	2023.07.05(수)	금통위	2023.07.13(목)	FOMC	2023.07.25(화) ~ 2023.07.26(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 한국은행, 최근 단기금융 및 채권 시장 불안과 한국은행의 시장안정화 조치 (2022.12.2)							https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 통화안정증권 정례입찰 운영방식 개선 (2023.06.22)							https://www.kofr.kr
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)							https://seibro.or.kr
· 2023년 지준 계산 적립기간 및 금통위							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

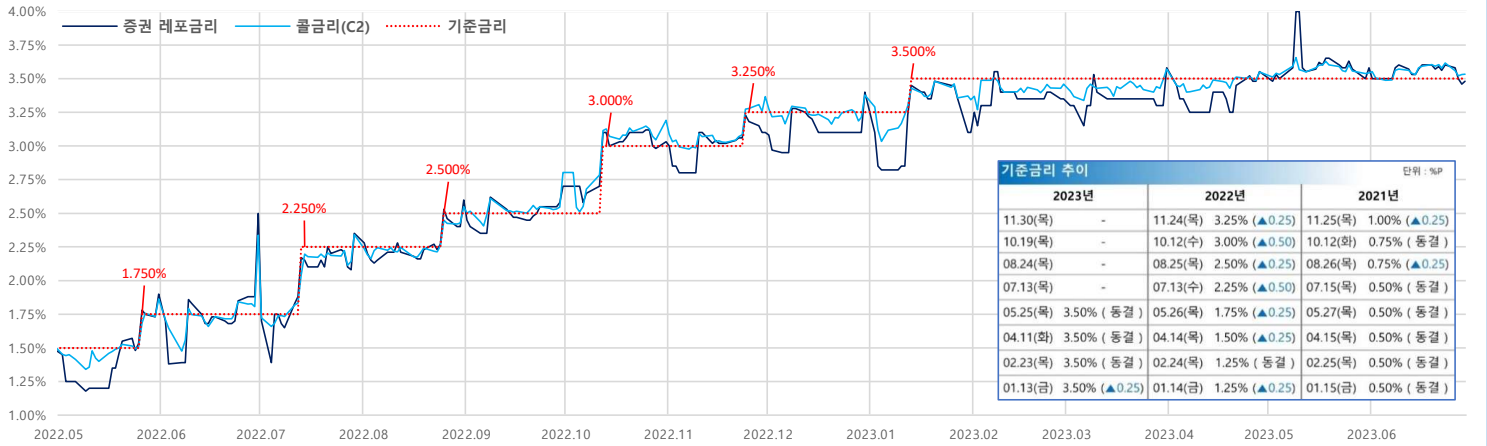
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	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

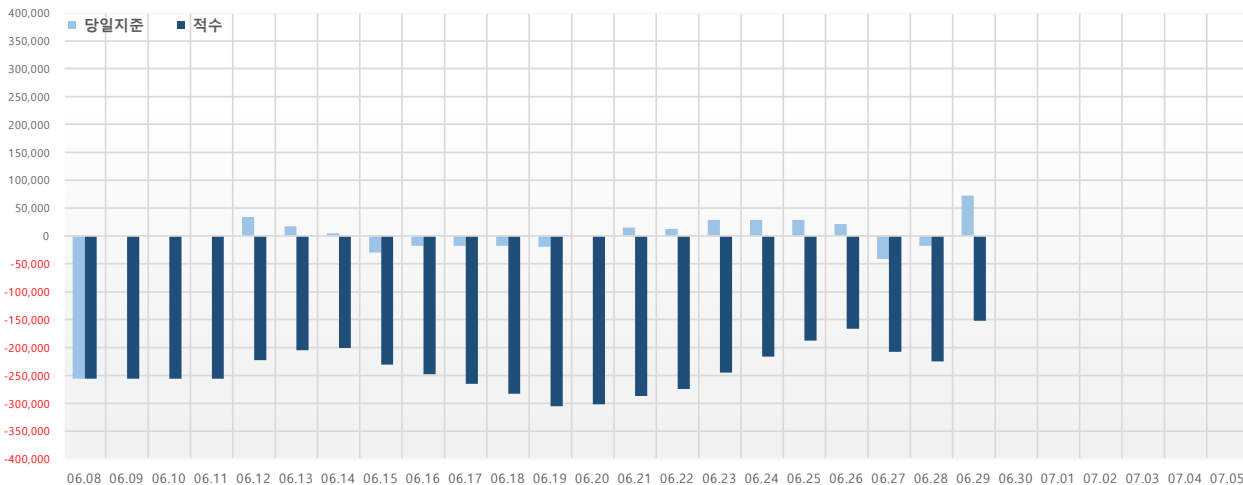


기준금리 추이				단위 : %P
	2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	-	11.24(목) 3.25% (▲0.25)	11.25(목) 1.00% (▲0.25)	
10.19(목)	-	10.12(수) 3.00% (▲0.50)	10.12(화) 0.75% (동결)	
08.24(목)	-	08.25(목) 2.50% (▲0.25)	08.26(목) 0.75% (▲0.25)	
07.13(목)	-	07.13(수) 2.25% (▲0.50)	07.15(목) 0.50% (동결)	
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목) 1.75% (▲0.25)	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
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)	21,374	-166,198
06.27(화)	-41,158	-207,355
06.28(수)	-17,319	-224,592
06.29(목)	72,214	-152,302
06.30(금)		
07.01(토)		
07.02(일)		
07.03(월)		
07.04(화)		
07.05(수)		