

레포 시장동향

- ◎ 전일
운용사 및 신탁 자금 회복된 반면, 증권사 조달 급감하여 조달여건 크게 개선되었음. 기준일 앞두고 은행권 매수·매도 혼재하여 막판까지 거래 활발하였음.
- ◎ 금일
공자기금 유입되어 유동성 풍부하겠으나 기준 마감 전 2일물 매수 많지 않아 기일별 조달여건 상이하겠음. 외국계은행 변수로 은행권 움직임 가변적일 전망.

기준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.07.03 (월)				2023.07.04 (화)					
통안채 이자		5,000		통안채 만기(91일)			13,400		
재정 [국세환급0.2 실시간0.5]		7,000		금융중개지원대출			5,000		
자금조정예금 만기		48,000		공자기금			26,000		
통안채 발행(91일)		-14,200		재정 [국세환급0.3 실시간0.4]			7,000		
금융중개지원대출 만기		-24,000		자금조정예금 만기			37,000		
공자기금 환수		-1,000		국고채 발행(3년)			-26,000		
세입		-22,000		월말세입			-96,000		
자금조정예금		-37,000		자금조정예금			-37,000		
기타		-4,000							
전일 기준	기준	33,327	적수	102,863	금일 예상	기준	-39,000	적수	63,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.06.27(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	173.6	3.48%	3.534%	3.523%		3.75%	3.584%	3.589%
2023.06.30(금)	174.1	167.3	3.85%	3.767%	3.841%		3.75%	3.662%	3.663%
2023.07.03(월)	168.5		3.48%	3.496%	3.516%		3.75%	3.613%	3.590%

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

◎ 통화안정증권정예치금

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	디비금융제11호스팩	기업인수목적회사	2023.07.03(월) ~ 2023.07.04(화)	2023.07.06(목)	DB금투
공모주	필에너지	2차전지 장비 제조기업	2023.07.05(수) ~ 2023.07.06(목)	2023.07.10(월)	미래 / 삼성
BW	대유플러스	유선 통신장비 제조기업	2023.07.05(수) ~ 2023.07.06(목)	2023.07.10(월)	한투

관련 정보

기준일	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)					www.bok.or.kr/portal/bbs/B0000347/view.do?nttlId=10074403&menuNo=201106	경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
한국은행, 통화안정증권 정례입찰 운영방식 개선 (2023.06.22)					www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlId=10077989&menuNo=200295	무위험지표금리	https://www.kofr.kr
한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)					www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttlId=10068266&menuNo=200460	증권정보포털	https://seibro.or.kr
2023년 기준 계산·적립기간 및 금통위					www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlId=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)		05.02(화) ~ 05.03(수)
2023년 5월	05.01(월)	05.31(수)	06.08(목)	07.05(수)	05.25(목)	05.11(목)		
2023년 6월	06.01(목)	06.30(금)	07.06(목)	08.09(수)		06.08(목)	06.21(수)	06.13(화) ~ 06.14(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)		09.19(화) ~ 09.20(수)
2023년 9월	09.01(금)	09.30(토)	10.12(목)	11.08(수)		09.14(목)	09.26(화)	
2023년 10월	10.01(일)	10.31(화)	11.09(목)	12.06(수)	10.19(목)	10.26(목)		10.31(화) ~ 11.01(수)
2023년 11월	11.01(수)	11.30(목)	12.07(목)	2024.01.10(수)	11.30(목)	11.09(목)		
2023년 12월	12.01(금)	12.31(일)	2024.01.11(목)	2024.02.07(수)		12.14(목)	12.28(목)	12.12(화) ~ 12.13(수)

레포 거래잔액 및 MMF 잔고 추이

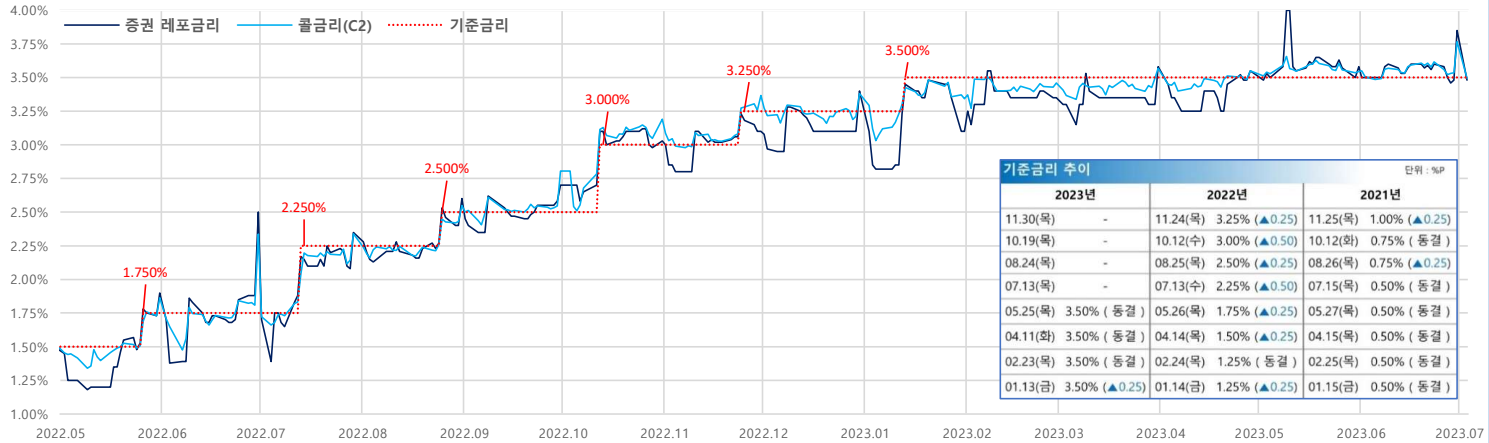
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전일대비	전월대비
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

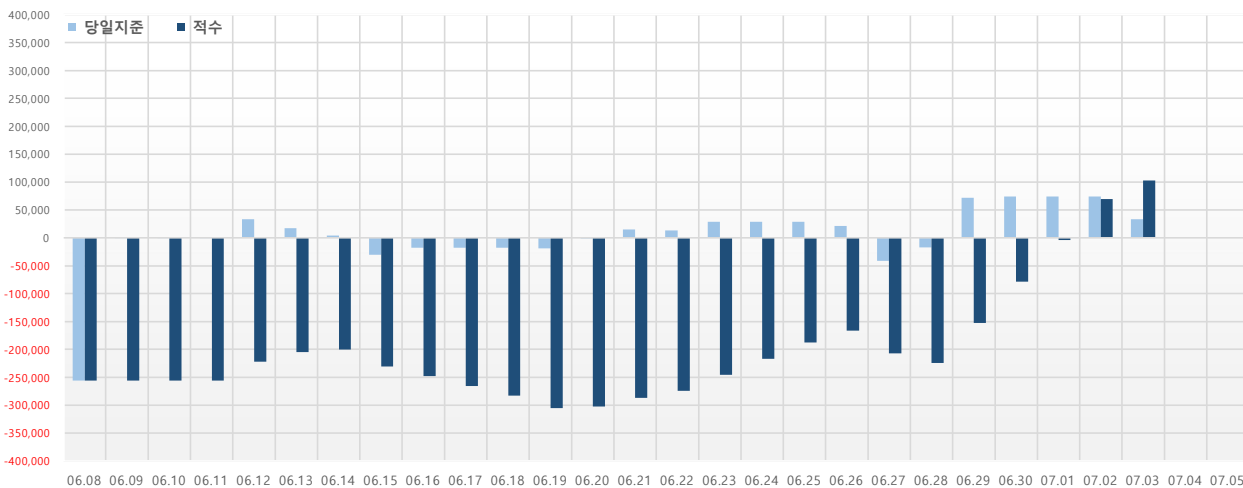


기준금리 추이			단위 : %P
2023년	2022년	2021년	
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)
08.24(목)	-	08.25(목)	2.50% (▲0.25)
07.13(목)	-	07.13(수)	2.25% (▲0.50)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	1.75% (▲0.25)
04.11(화)	3.50% (동결)	04.14(목)	1.50% (▲0.25)
02.23(목)	3.50% (동결)	02.24(목)	1.25% (동결)
01.13(금)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

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)	74,015	-78,291
07.01(토)	74,015	-4,276
07.02(일)	74,015	69,739
07.03(월)	33,327	102,863
07.04(화)		
07.05(수)		