

레포 시장동향

◎ 전일

공자기금 유입되어 운용사 및 신탁 매수 증가했으며, 지준 마감 전임에도 시은 2일물 운용 꾸준하여 장중 잉여세 심화되었음.

◎ 금일

지준 잉여 마감 예상되는 가운데 은행 간 콜 거래가 주를 이루겠으며, 레포 전일자 롤오버를 제외한 신규 거래 제한적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2023.07.04 (화) | | | | 2023.07.05 (수) | | | | | |
|-----------------------|-----------|----------------|-----------|-----------------------|--------------|-----------|----------------|-----------|---------------|
| 통안채 만기(91일) | | 13,400 | | 공자기금 | | | 2,000 | | |
| 금융중개지원대출 | | 5,000 | | 재정 [국세환급0.4 실시간0.2] | | | 6,000 | | |
| 공자기금 | | 26,000 | | 자금조정예금 만기 | | | 41,000 | | |
| 재정 [국세환급0.4 실시간0.5] | | 9,000 | | | | | | | |
| 자금조정예금 만기 | | 37,000 | | | | | | | |
| 국고채 발행(3년) | | -26,000 | | 세입 | | | -8,000 | | |
| 월말세입 | | -96,000 | | 자금조정예금 | | | -38,000 | | |
| 자금조정예금 | | -41,000 | | | | | | | |
| 기타 | | -6,000 | | | | | | | |
| 전일 기준 | 지준 | -47,624 | 적수 | 55,240 | 금일 예상 | 지준 | -44,000 | 적수 | 10,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2023.06.28(수) | 180.1 | 177.0 | 3.46% | 3.531% | 3.501% | 3.500% | 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 | 168.1 | 3.48% | 3.496% | 3.516% | | 3.75% | 3.613% | 3.590% |
| 2023.07.04(화) | 165.6 | | 3.48% | 3.454% | 3.523% | | 3.74% | 3.619% | 3.597% |

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 |

◎ 통화안정증권예치금

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

| 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) | | 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

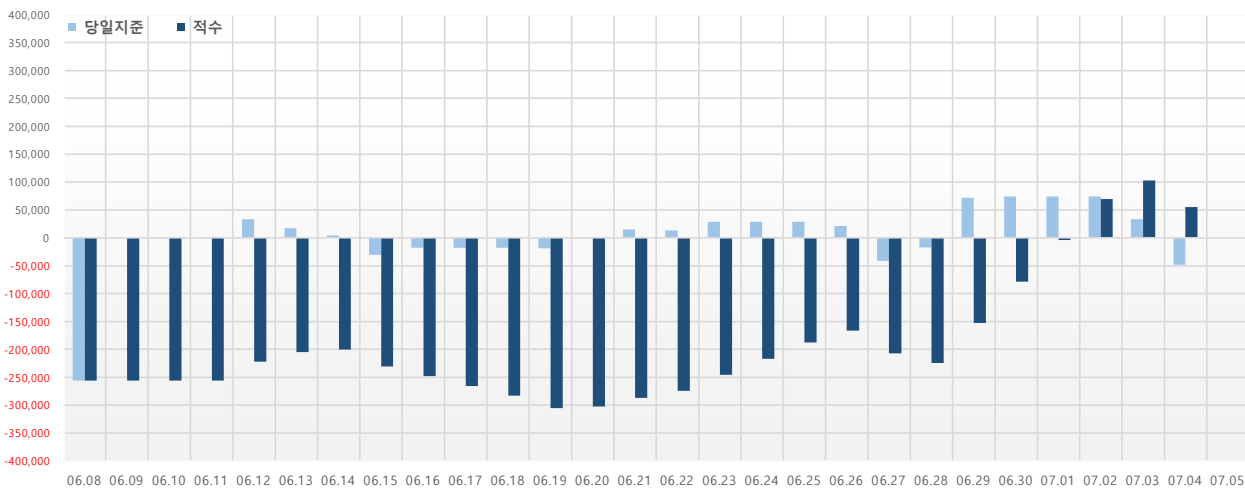


| 기준금리 추이 | | | 단위 : %P | | | | | |
|----------|-------|----------|----------|---------|----------|----------|---------|------|
| 2023년 | 2022년 | 2021년 | | | | | | |
| 11.30(목) | - | 11.24(목) | 3.25% | (▲0.25) | 11.25(목) | 1.00% | (▲0.25) | |
| 10.19(수) | - | 10.12(수) | 3.00% | (▲0.50) | 10.12(화) | 0.75% | (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) | 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) | -47,624 | 55,240 |
| 07.05(수) | | |