

레포 시장동향

- ◎ 전주
주초 운용사 및 신탁 자금 회복되어 조달여건 크게 개선되었으며, 레포금리 2개월 여 만에 기준금리를 하회하였음.
반기말부터 계속된 외국계은행 변수 해결되지 않아 지준 마감일까지 은행권 양방향 움직임 혼재한 모습이었음.
주 중반 이후 새마을금고 이슈 부각되어 시장 타이프한 분위기 감지되었고, 주말 앞두고 금리 급등하였음.

- ◎ 금일
청약자금 환볼 영향으로 유동성 축소될 것으로 예상되며, 은행권 운용 여부에 따라 수급 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.07.07 (금)				2023.07.10 (월)			
재정 [국세환급0.5 실시간0.4]		9,000		통안채 만기(1년)			17,100
자금조정예금 만기		36,000		제기금			3,000
기타		2,000		재정 [국세환급0.7 실시간0.5]			12,000
				자금조정예금 만기			52,000
세입		-6,000		공자기금 환수			-5,000
자금조정예금		-52,000		국고채 발행(50년)			-5,000
				세입			-6,000
				자금조정예금			-52,000
전일 기준	지준	-10,438	적수	금일 예상	지준	6,000	적수
							-6,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.07.03(월)	168.5	168.1	3.48%	3.496%	3.516%	3.500%	3.75%	3.613%	3.590%
2023.07.04(화)	165.6	178.7	3.48%	3.454%	3.523%		3.74%	3.619%	3.597%
2023.07.05(수)	167.1	180.3	3.48%	3.454%	3.523%		3.74%	3.618%	3.606%
2023.07.06(목)	169.2	180.1	3.50%	3.542%	3.528%		3.74%	3.676%	3.675%
2023.07.07(금)	173.0		3.57%	3.588%	3.584%		3.75%	3.735%	3.733%

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
2023.07.06(목)	14:00~14:10	7	2023.07.13(목)	17.84	3.50%	12.00	67.3%	2023-037-007

◎ 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	주공사 / 인수사 (증거금)
공모주	필에너지	2차전지 장비 제조기업	2023.07.05(수) ~ 2023.07.06(목)	2023.07.10(월)	미래 / 삼성 (15.8조)
BW	대유플러스	유선 통신장비 제조기업	2023.07.05(수) ~ 2023.07.06(목)	2023.07.10(월)	한투
공모주	센서뷰	RF연결솔루션 전문 기업	2023.07.10(월) ~ 2023.07.11(화)	2023.07.13(목)	삼성
공모주	와이랩	스튜디오형 웹툰 제작기업	2023.07.10(월) ~ 2023.07.11(화)	2023.07.13(목)	한투
실권주	인텔리안테크	위성통신 안테나 개발 기업	2023.07.10(월) ~ 2023.07.11(화)	2023.07.13(목)	한투
공모주	에스케이증권제9호스팩	기업인수목적회사	2023.07.11(화) ~ 2023.07.12(수)	2023.07.14(금)	SK
공모주	뷰티스킨	종합 화장품 기업	2023.07.13(목) ~ 2023.07.14(금)	2023.07.18(화)	DB금투

관련 정보

지준일	금통위	FOMC	한국은행
2023.08.09(수)	2023.07.13(목)	2023.07.25(화) ~ 2023.07.26(수)	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?nttid=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?nttid=10077989&menuNo=200295		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

기준 계산·적립기간, 금통위 및 FOMC

	기준 계산기간		기준 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
2023.06.30	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

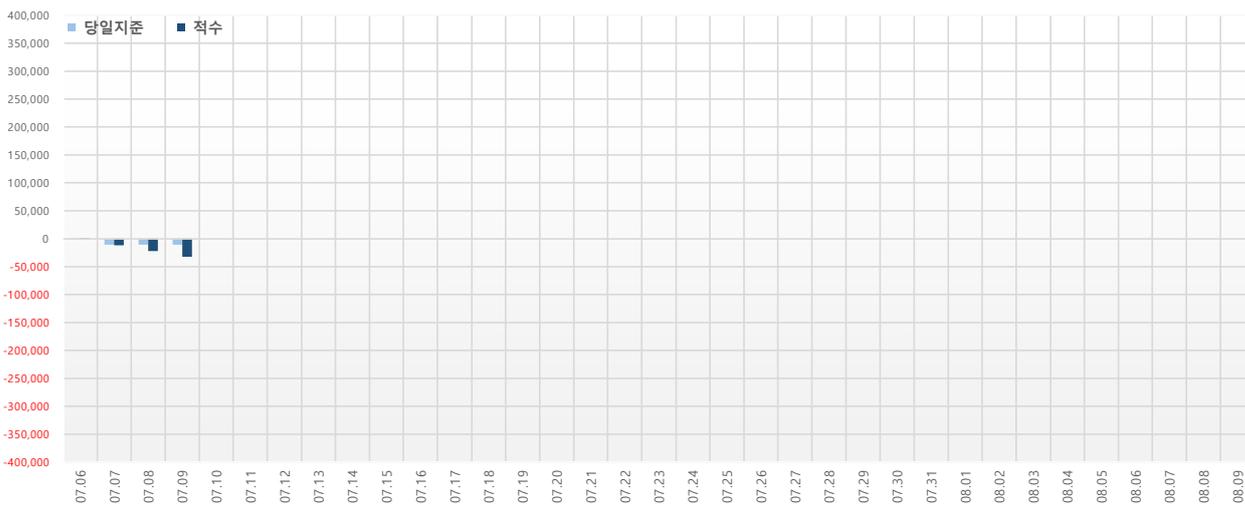


기준금리 추이			단위 : %P					
2023년	2022년	2021년						
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25%	(▲0.25)	11.25(목)	1.00%	(▲0.25)	
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00%	(▲0.50)	10.12(화)	0.75%	(동결)	
08.24(목)	-	08.25(목)	2.50%	(▲0.25)	08.26(목)	0.75%	(▲0.25)	
07.13(목)	-	07.13(수)	2.25%	(▲0.50)	07.15(목)	0.50%	(동결)	
05.25(목)	3.50%	(동결)	05.26(목)	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
07.06(목)	983	983
07.07(금)	-10,438	-11,461
07.08(토)	-10,438	-21,899
07.09(일)	-10,438	-32,337
07.10(월)		
07.11(화)		
07.12(수)		
07.13(목)		
07.14(금)		
07.15(토)		
07.16(일)		
07.17(월)		
07.18(화)		
07.19(수)		
07.20(목)		
07.21(금)		
07.22(토)		
07.23(일)		
07.24(월)		
07.25(화)		
07.26(수)		
07.27(목)		
07.28(금)		
07.29(토)		
07.30(일)		
07.31(월)		
08.01(화)		
08.02(수)		
08.03(목)		
08.04(금)		
08.05(토)		
08.06(일)		
08.07(월)		
08.08(화)		
08.09(수)		