

Repo Market Report

2023.07.13 (목) 금통위



자금시장부 6021-5832

레포 시장동향

- ◎ 전일
청약 및 건보자금 유입되어 조달여건 크게 개선되었으며, 장중 매수 자금 증가하여 잉여 분위기 형성되었음.
- ◎ 금일
건보자금 유효하여 청약 환불 및 공자 환수 영향 제한적이겠으며, 은행권 적수 관리를 위한 매수·매도 혼재할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2023.07.12 (수) | | | | 2023.07.13 (목) | | | |
|---|-----------|---------------|-----------|-----------------------|--------------|-----------|----------------|
| 재정 [교육부4.7 복지부0.6 국세환급0.2 실시간0.3] | | 58,000 | | 한은RP매각 만기(7일) | | | 120,000 |
| 자금조정예금 만기 | | 38,000 | | 재정증권 만기(63일) | | | 15,000 |
| 기타 | | 4,000 | | 재정 [국세환급0.2 실시간0.5] | | | 7,000 |
| | | | | 자금조정예금 만기 | | | 37,000 |
| 월천세 | | -89,000 | | 한은RP매각(7일) | | | -100,000 |
| 제기금 환수 | | -6,000 | | 재정증권 발행(63일) | | | -15,000 |
| 자금조정예금 | | -37,000 | | 공자기금 환수 | | | -20,000 |
| | | | | 세입 | | | -4,000 |
| | | | | 자금조정예금 | | | -37,000 |
| 전일 기준 | 지준 | -4,250 | 적수 | -15,810 | 금일 예상 | 지준 | -1,000 |
| | | | | | | 적수 | -17,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2023.07.06(목) | 169.2 | 180.1 | 3.50% | 3.542% | 3.528% | 3.500% | 3.74% | 3.676% | 3.675% |
| 2023.07.07(금) | 173.0 | 179.9 | 3.57% | 3.588% | 3.584% | | 3.75% | 3.735% | 3.733% |
| 2023.07.10(월) | 172.9 | 176.3 | 3.58% | 3.582% | 3.597% | | 3.75% | 3.795% | 3.810% |
| 2023.07.11(화) | 173.3 | 177.2 | 3.56% | 3.556% | 3.577% | | 3.75% | 3.703% | 3.721% |
| 2023.07.12(수) | 176.3 | | 3.50% | 3.527% | 3.523% | | 3.75% | 3.704% | 3.720% |

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

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정금액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰금액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 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 |
| 2023.07.11(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 | 센서뷰 | RF연결솔루션 전문 기업 | 2023.07.10(월) ~ 2023.07.11(화) | 2023.07.13(목) | 삼성 (3.44조) |
| 공모주 | 와이랩 | 스튜디오형 웹툰 제작기업 | 2023.07.10(월) ~ 2023.07.11(화) | 2023.07.13(목) | 한투 (6.47조) |
| 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 (165억) |
| 공모주 | 뷰티스킨 | 종합 화장품 기업 | 2023.07.13(목) ~ 2023.07.14(금) | 2023.07.18(화) | DB금투 |

관련 정보

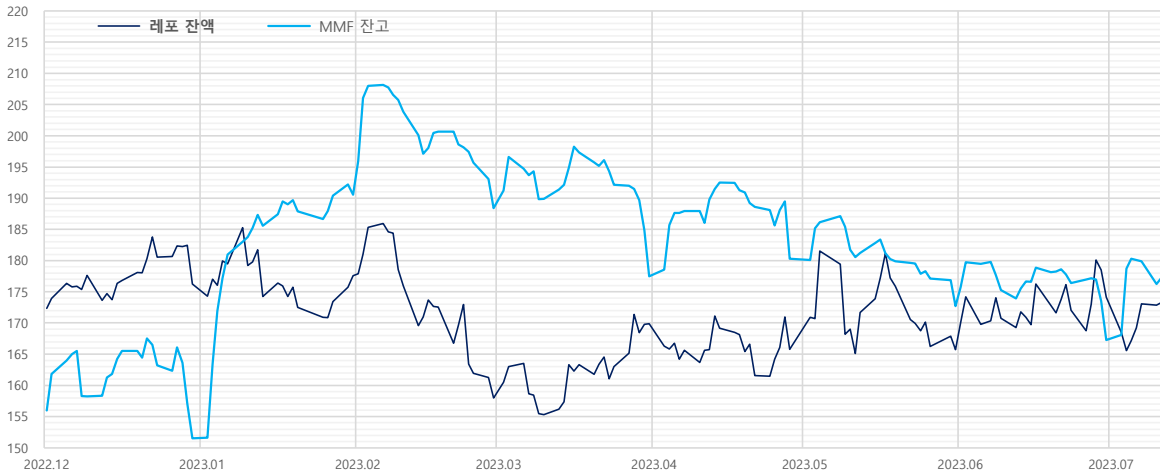
| 지준일 | 2023.08.09(수) | 금통위 | 2023.07.13(목) | FOMC | 2023.07.25(화) ~ 2023.07.26(수) | 한국은행 | http://www.bok.or.kr |
|---|--|-----|---------------|------|-------------------------------|---------|---|
| · 한국은행, 최근 단기금융 및 채권 시장 불안과 한국은행의 시장안정화 조치 (2022.12.26) | www.bok.or.kr/portal/bbs/B0000347/view.do?nttlid=10074403&menuNo=201106 | | | | | 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 지준 계산·적립기간 및 금통위 | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlid=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

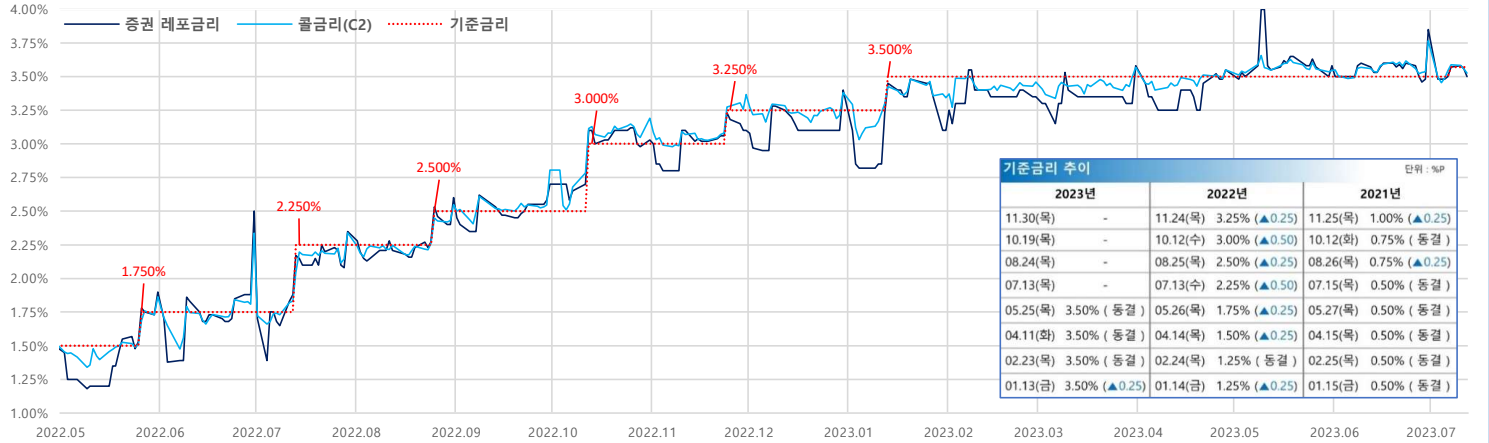
단위 : 조 원



| 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

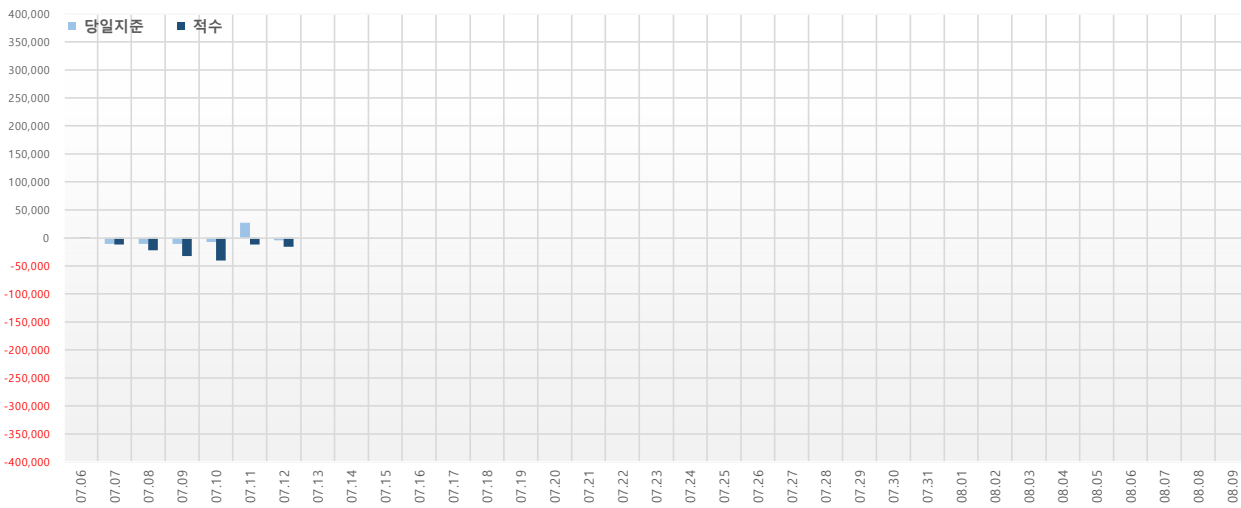


| 기준금리 추이 | | | 단위 : %P | |
|----------|-------|----------|---------|---------|
| 2023년 | 2022년 | 2021년 | | |
| 11.30(목) | - | 11.24(목) | 3.25% | (▲0.25) |
| 10.19(목) | - | 10.12(수) | 3.00% | (▲0.50) |
| 08.24(목) | - | 08.25(목) | 2.50% | (▲0.25) |
| 07.13(목) | - | 07.13(수) | 2.25% | (▲0.50) |
| 05.25(목)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

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) | -6,798 | -40,175 |
| 07.11(화) | 27,613 | -11,563 |
| 07.12(수) | -4,250 | -15,810 |
| 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) | | |