

Repo Market Report

2023.07.19 (수)



자금시장부 6021-5832

레포 시장동향

◎ 전일

공자기금 유입되어 단기자금시장 잉여 출발했으나 장중 시은 및 증권 매도 추가되어 막판 수급 빠듯한 양상을 보임.

◎ 금일

운용사 및 은행신탁 유동성 풍부한 가운데 청약자금 운용으로 잉여세 강하했으며, 금리 수준에 따라 은행권 조달 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.07.18 (화)				2023.07.19 (수)			
통안계정 만기(28일)		27,500		공자기금			9,000
통안채 만기(91일)		14,200		재정 [국채환급0.1 실시간1.1]			12,000
공자기금		23,000		자금조정예금 만기			36,000
재정 [국채환급0.5 실시간0.4]		9,000					
자금조정예금 만기		39,000					
기타		2,000					
통안계정(29일)		-48,000		국고채 발행(20년)			-9,000
통안채 발행(91일)		-15,300		세입			-12,000
국고채 발행(5년)		-23,000		자금조정예금			-36,000
세입		-4,000					
자금조정예금		-36,000					
전일 기준	지준	45,685	적수	238,211	금일 예상	지준	46,000
						적수	284,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.07.12(수)	176.3	178.8	3.50%	3.527%	3.523%	3.500%	3.75%	3.704%	3.720%
2023.07.13(목)	174.8	180.8	3.53%	3.541%	3.549%		3.75%	3.602%	3.610%
2023.07.14(금)	176.0	183.9	3.48%	3.507%	3.508%		3.75%	3.614%	3.631%
2023.07.17(월)	177.0	183.3	3.48%	3.506%	3.508%		3.75%	3.611%	3.619%
2023.07.18(화)	178.4		3.47%	3.510%	3.500%		3.75%	3.596%	3.609%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2023.07.13(목)	3.50% (동결)	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)
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)

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
2023.07.13(목)	14:00~14:10	7	2023.07.20(목)	27.63	3.50%	9.00	32.6%	2023-038-007

◎ 통화안정증권예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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	2023-0025-0028
2023.07.18(화)	14:00~14:10	29	2023.08.16(수)	4.00	5.50	3.52%	4.80	2023-0026-0029

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	에이엘티	반도체 후공정 테스트 기업	2023.07.17(월) ~ 2023.07.18(화)	2023.07.20(목)	미래 (7.07조)
공모주	버네트	XR(확장현실) 테크 기업	2023.07.17(월) ~ 2023.07.18(화)	2023.07.20(목)	대신 (5.04조)
공모주	유안타제14호스팩	기업인수목적회사	2023.07.17(월) ~ 2023.07.18(화)	2023.07.20(목)	유안타 (484억)
공모주	파로스아이바이오	SI 기반 신약 개발 기업	2023.07.17(월) ~ 2023.07.18(화)	2023.07.20(목)	한투 (8,500억)
실권주	옵니시스템	원격검침시스템 전문 기업	2023.07.17(월) ~ 2023.07.18(화)	2023.07.20(목)	한양

관련 정보

지준일	2023.08.09(수)	금통위	2023.08.24(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

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

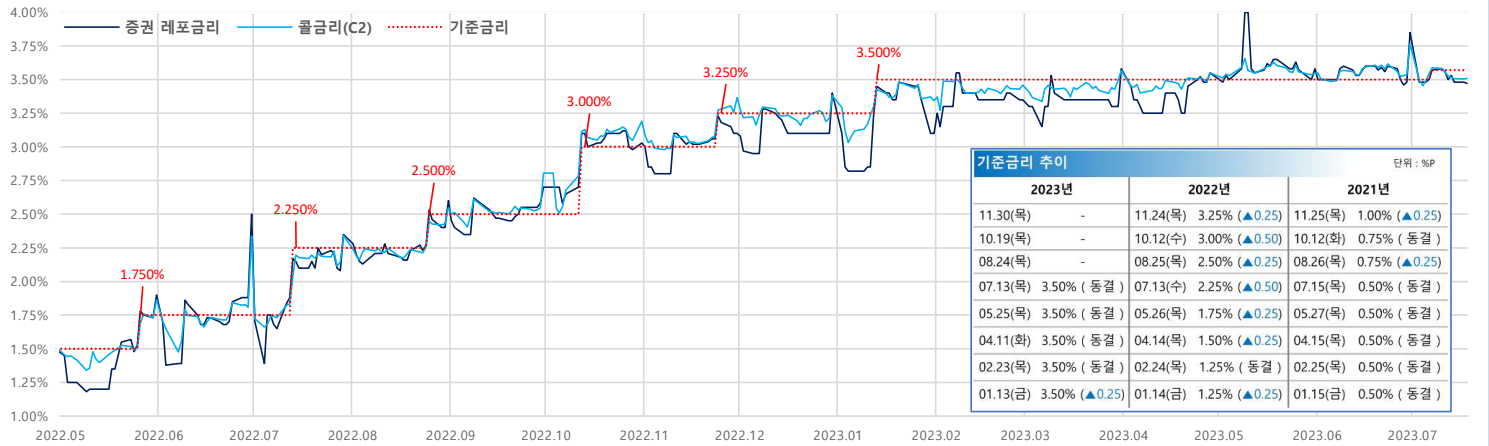
단위 : 조 원



해당연월	월일별 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

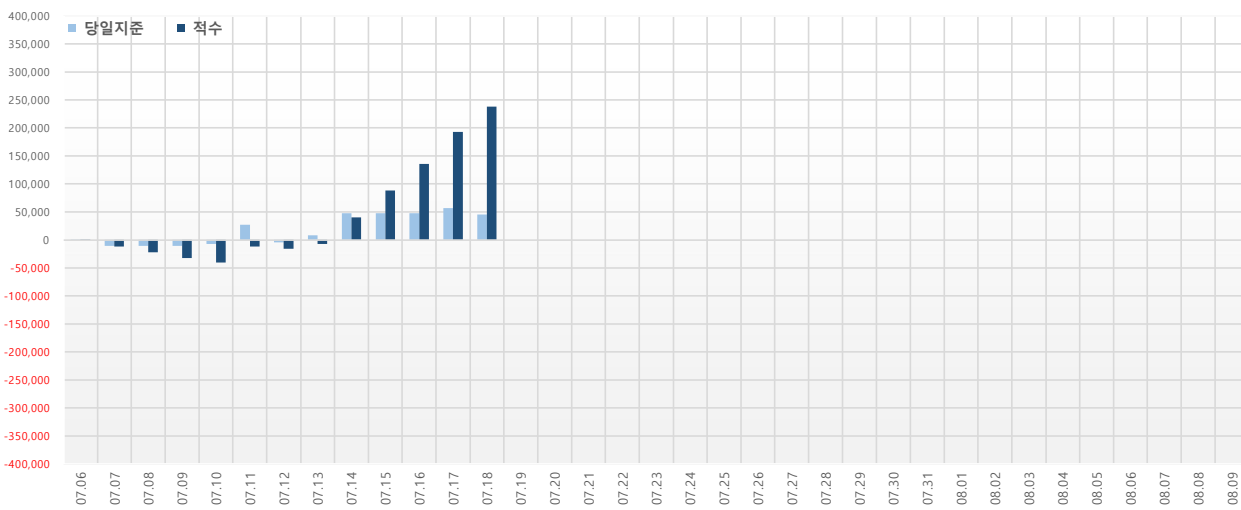


기준금리 추이				단위 : %P	
2023년	2022년	2021년			
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	-	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.25)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	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)	-6,798	-40,175
07.11(화)	27,613	-11,563
07.12(수)	-4,250	-15,810
07.13(목)	8,430	-7,382
07.14(금)	47,692	40,311
07.15(토)	47,692	88,003
07.16(일)	47,692	135,695
07.17(월)	56,833	192,500
07.18(화)	45,685	238,211
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)		