

Repo Market Report

2023.07.24 (월)



자금시장부 6021-5832

레포 시장동향

◎ 전주

한 주 내내 당일기준 플러스 유지되어 주 후반부로 갈수록 적수 잉여폭 확대되었고, 시은 콜-레포 조달에 소극적이었음.
공자기금 유입과 청약자금 운용으로 잉여세 유지되었으며, 청약 환불일 일시적으로 금리 상승했으나 주간 유동성 풍부하였음.
주말 전 적수 부담으로 은행권 운용에 집중했고, 증권사 매도 또한 급감하여 익일물 및 기일물 조달금리 동반 하락하였음.

◎ 금일

공자기금 환수에도 잉여세 계속되겠으며, 청약 흥행 여부에 따라 장중 증권사 매도 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.07.21 (금)				2023.07.24 (월)					
공자기금		7,000	재정 [교육부1.2 국세환급0.1 실시간0.2]				15,000		
재정 [국세환급0.1 실시간1.6]		17,000	자금조정예금 만기				36,000		
자금조정예금 만기		37,000							
국고채 비경쟁인수		-8,000	공자기금 환수				-10,000		
세입		-10,000	세입				-15,000		
자금조정예금 만기		-36,000	자금조정예금 만기				-40,000		
기타		-2,000							
전일 기준	지준	104,348	적수	488,094	금일 예상	지준	90,000	적수	788,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
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	183.6	3.47%	3.510%	3.500%		3.75%	3.596%	3.609%
2023.07.19(수)	179.4	183.3	3.47%	3.502%	3.500%	3.500%	3.75%	3.543%	3.542%
2023.07.20(목)	175.2	182.2	3.53%	3.528%	3.550%		3.75%	3.581%	3.581%
2023.07.21(금)	171.7		3.51%	3.481%	3.534%		3.75%	3.602%	3.601%

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
2023.07.20(목)	14:00~14:10	7	2023.07.27(목)	28.34	3.50%	9.00	31.8%	2023-039-007

◎ 통화안정계정예치금

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)
BW	에이프로젠H&G	의약품 유통 기업	2023.07.20(목) ~ 2023.07.21(금)	2023.07.25(화)	신한
공모주	시지트로닉스	반도체 소자 제조 기업	2023.07.24(월) ~ 2023.07.25(화)	2023.07.27(목)	유안타
실권주	엘앤케이바이오	바이오 의료기기 제조 기업	2023.07.24(월) ~ 2023.07.25(화)	2023.07.27(목)	BNK
공모주	엠아이큐브솔루션	스마트팩토리 솔루션 기업	2023.07.26(수) ~ 2023.07.27(목)	2023.07.31(월)	한투
실권주	엔비에이치코리아	자동차 부품 제조 기업	2023.07.26(수) ~ 2023.07.27(목)	2023.07.31(월)	BNK
공모주	파두	반도체 설계 기업	2023.07.27(목) ~ 2023.07.28(금)	2023.08.01(화)	NH·한투 / 유진·한화·현대차·KB

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

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)		
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

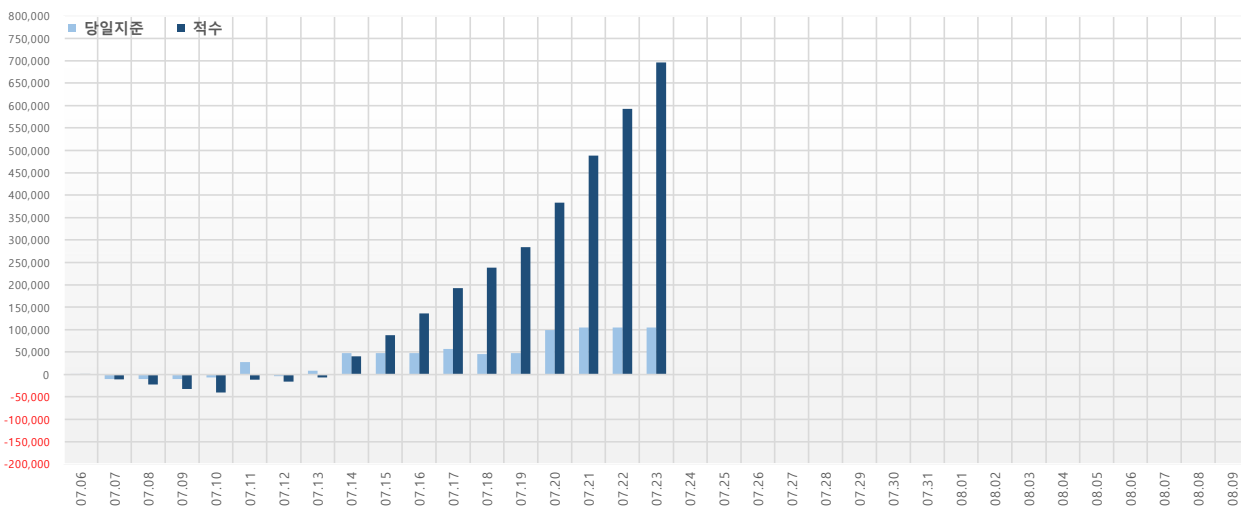


기준금리 추이				단위 : %P	
2023년	2022년	2021년			
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	-	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	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)	-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)	47,487	283,698
07.20(목)	99,030	383,231
07.21(금)	104,348	488,094
07.22(토)	104,348	592,442
07.23(일)	104,348	696,790
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)		