

# Repo Market Report

2023.07.27 (목)



자금시장부 6021-5832

## 레포 시장동향

### ◎ 전일

부가세 선납에도 당일기준 플러스 유지되어 은행권 저금리 조달에만 관심을 보였으며, 증권사 매도 감소하여 장중 금리 하락하였음.

### ◎ 금일

국고여유자금 유입 규모 상당하여 시장 잉여세 심화되었음. 청약 관련 증권사 매도 추이와 부가세 본납에 따른 시은 움직임이 변수로 작용할 전망.

## 지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.07.26 (수)				2023.07.27 (목)					
재정 [국세환급0.1   실시간0.3]			4,000	한은RP매각 만기(7일)			90,000		
자금조정예금 만기			35,000	재정증권 만기(63일)			15,000		
기타			1,000	국고여유자금			89,000		
				재정 [국세환급0.1   실시간0.3]			4,000		
				자금조정예금 만기			36,000		
부가세 선납			-51,000	한은RP매각(7일)			-90,000		
자금조정예금			-36,000	동안채 발행(1년), 시장수익률 3.645%			-2,000		
				동안채 발행(2년), 시장수익률 3.720%			-8,000		
				동안채 발행(3년), 시장수익률 3.755%			-2,000		
				재정증권 발행(63일)			-15,000		
				부가세 본납			-198,000		
				자금조정예금			-36,000		
전일 기준	지준	33,905	적수	901,343	금일 예상	지준	-83,000	적수	818,000

## Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.07.20(목)	175.2	182.2	3.53%	3.528%	3.550%	3.500%	3.75%	3.581%	3.581%
2023.07.21(금)	171.7	182.1	3.51%	3.481%	3.534%		3.75%	3.602%	3.601%
2023.07.24(월)	171.9	182.7	3.45%	3.498%	3.479%		3.75%	3.617%	3.607%
2023.07.25(화)	168.9	182.9	3.45%	3.490%	3.485%		3.75%	3.645%	3.643%
2023.07.26(수)	169.0		3.43%	3.483%	3.465%		3.75%	3.627%	3.622%

## 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

### ◎ 통화안정증권예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2023.07.11(화)	14:00~14:10	28	2023.08.08(화)	1.00	1.85	3.52%	1.00	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
2023.07.25(화)	14:00~14:10	28	2023.08.22(화)	4.00	5.15	3.50%	4.70	2023-0027-0028

## 청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	시지트로닉스	반도체 소자 제조 기업	2023.07.24(월) ~ 2023.07.25(화)	2023.07.27(목)	유안타 (2.6조)
공모주	엠아이큐브솔루션	스마트팩토리 솔루션 기업	2023.07.26(수) ~ 2023.07.27(목)	2023.07.31(월)	한투
실권주	엔브이에이치코리아	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	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	한국은행	<a href="http://www.bok.or.kr">http://www.bok.or.kr</a>
· 한국은행, 최근 단기금융 및 채권 시장 불안과 한국은행의 시장안정화 조치 (2022.12.26)							<a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/B0000347/view.do?nttld=10074403&amp;menuNo=201106">www.bok.or.kr/portal/bbs/B0000347/view.do?nttld=10074403&amp;menuNo=201106</a>
· 한국은행, 통화안정증권 정례입찰 운영방식 개선 (2023.06.22)							<a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttld=10077989&amp;menuNo=200295">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttld=10077989&amp;menuNo=200295</a>
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)							<a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttld=10068266&amp;menuNo=200460">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttld=10068266&amp;menuNo=200460</a>
· 2023년 지준 계산-적립기간 및 금통위							<a href="http://www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttld=10074187&amp;menuNo=200295">www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttld=10074187&amp;menuNo=200295</a>
						경제통계시스템	<a href="https://ecos.bok.or.kr">https://ecos.bok.or.kr</a>
						무위험지표금리	<a href="https://www.kofr.kr">https://www.kofr.kr</a>
						증권정보포털	<a href="https://seibro.or.kr">https://seibro.or.kr</a>
						금융투자협회	<a href="https://kofiabond.or.kr">https://kofiabond.or.kr</a>

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

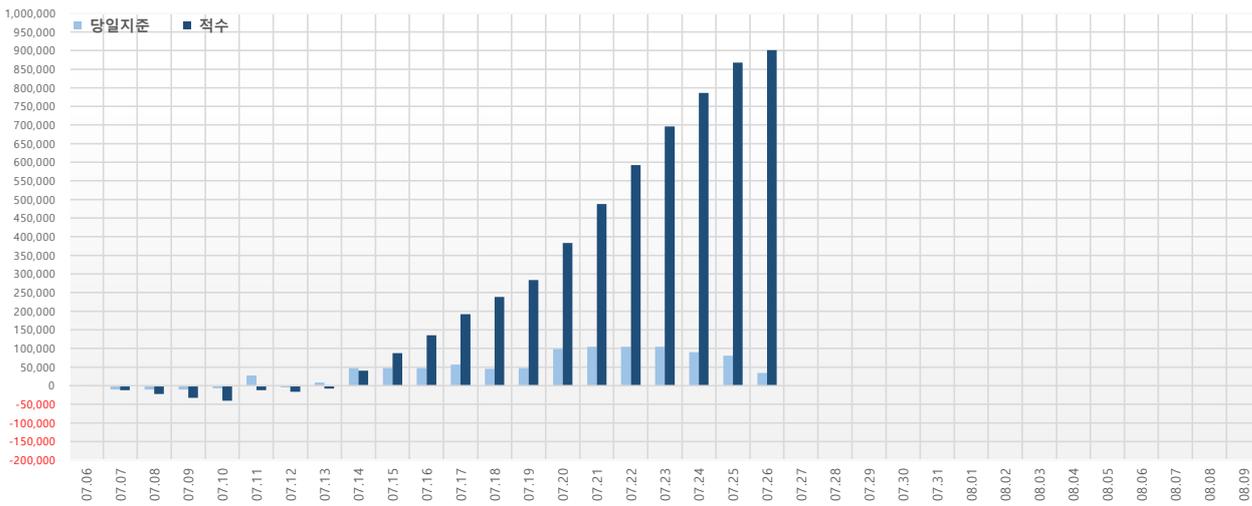


기준금리 추이			단위 : %P					
2023년	2022년	2021년	2023년	2022년	2021년			
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25%	(▲0.25)	11.25(목)	1.00%	(▲0.25)	
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00%	(▲0.50)	10.12(화)	0.75%	(동결)	
08.24(목)	-	08.25(목)	2.50%	(▲0.25)	08.26(목)	0.75%	(▲0.25)	
07.13(목)	3.50%	(동결)	07.13(수)	2.25%	(▲0.50)	07.15(목)	0.50%	(동결)
05.25(목)	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
07.07(금)	-10,438
07.08(토)	-10,438
07.09(일)	-10,438
07.10(월)	-6,798
07.11(화)	27,613
07.12(수)	-4,250
07.13(목)	8,430
07.14(금)	47,692
07.15(토)	47,692
07.16(일)	47,692
07.17(월)	56,833
07.18(화)	45,685
07.19(수)	47,487
07.20(목)	99,030
07.21(금)	104,348
07.22(토)	104,348
07.23(일)	104,348
07.24(월)	89,916
07.25(화)	80,988
07.26(수)	33,905
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)	