

레포 시장동향

◎ 전일

월초 MMF 설정과 국고금 유입으로 금리 하락 출발하였음. 시은 저금리 매도 증가했으며, 유동성 풍부해 조달 원활하였음.

◎ 금일

통안채 만기 및 국고금 추가 유입 영향으로 시장 잉여세 심화될 전망. 장중 은행권 저금리 조달 강도에 따라 자금 해소 가변적이겠음.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.08.01 (화)				2023.08.02 (수)			
통안채 만기(91일)		17,200		통안채 만기 및 이자(2년)			72,300
공자기금		30,000		금융중개지원대출 신규			7,000
국고여유자금		9,000		공자기금			1,000
재정 [국세환급0.1 실시간1.1]		12,000		국고여유자금			53,000
자금조정예금 만기		43,000		재정 [국세환급0.8 실시간0.6]			14,000
기타		1,000		자금조정예금 만기			38,000
통안계정(28일)		-22,200		국고채 비경쟁인수			-1,000
통안채 발행(91일)		-12,200		월말세입			-84,000
국고채 발행(30년)		-30,000		자금조정예금			-40,000
금융중개지원대출 만기		-33,000					
월말세입		-15,000					
자금조정예금		-38,000					
전일 기준	지준	-133,650	적수	311,458	금일 예상	지준	-73,000
						적수	238,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.07.27(목)	169.0	185.5	3.43%	3.483%	3.465%	3.500%	3.75%	3.627%	3.622%
2023.07.28(금)	176.1	187.7	3.43%	3.446%	3.449%		3.74%	3.587%	3.588%
2023.07.31(월)	174.2	187.6	3.43%	3.461%	3.456%		3.74%	3.635%	3.643%
2023.08.01(화)	171.8	182.4	3.48%	3.488%	3.511%		3.74%	3.681%	3.697%
2023.08.02(수)	174.4		3.43%	3.455%	3.466%		3.74%	3.647%	3.667%

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

◎ RP매각

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.07.27(목)	14:00~14:10	7	2023.08.03(목)	31.35	3.50%	10.00	31.9%	2023-040-007

◎ 통화안정계정예치금

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
2023.08.01(화)	14:00~14:10	28	2023.08.29(화)	2.00	2.72	3.52%	2.22	2023-0028-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간사 / 인수사 (증거금)
공모주	KB제26호스팩	기업인수목적회사	2023.07.31(월) ~ 2023.08.01(화)	2023.08.03(목)	KB
공모주	하나제28호스팩	기업인수목적회사	2023.08.01(화) ~ 2023.08.02(수)	2023.08.04(금)	하나
공모주	큐리옥스바이오시스템즈	세포분석공정 자동화 기업	2023.08.01(화) ~ 2023.08.02(수)	2023.08.04(금)	키움
공모주	코츠테크놀로지	방위산업 시스템 기업	2023.08.01(화) ~ 2023.08.02(수)	2023.08.04(금)	한투 / 하이
공모주	SK증권제10호스팩	기업인수목적회사	2023.08.01(화) ~ 2023.08.02(수)	2023.08.04(금)	SK
실권주	진원생명과학	의약품 개발 및 생산 기업	2023.08.03(목) ~ 2023.08.04(금)	2023.08.08(화)	한투

관련 정보

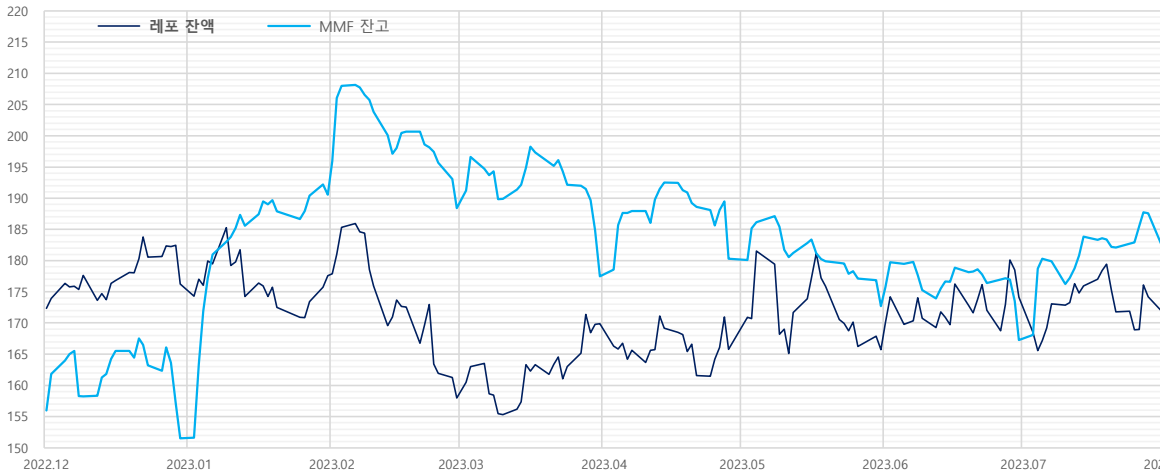
지준일	2023.08.09(수)	금통위	2023.08.24(목)	FOMC	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlId=10078655&menuNo=200690		경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
한국은행, 공개시장운영 대상기관 선정 (2023.07.27)				www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlId=10078659&menuNo=200690		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

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)		07.28(금)	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

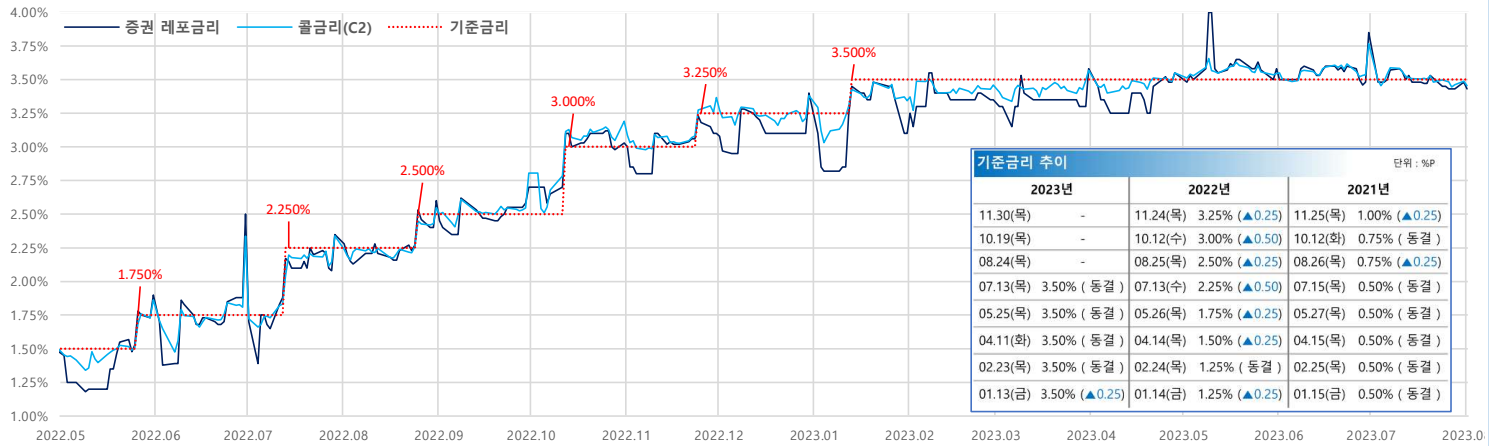
단위 : 조 원



해당연월	월말일 MMF 증감내역		
	MMF	전월대비	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

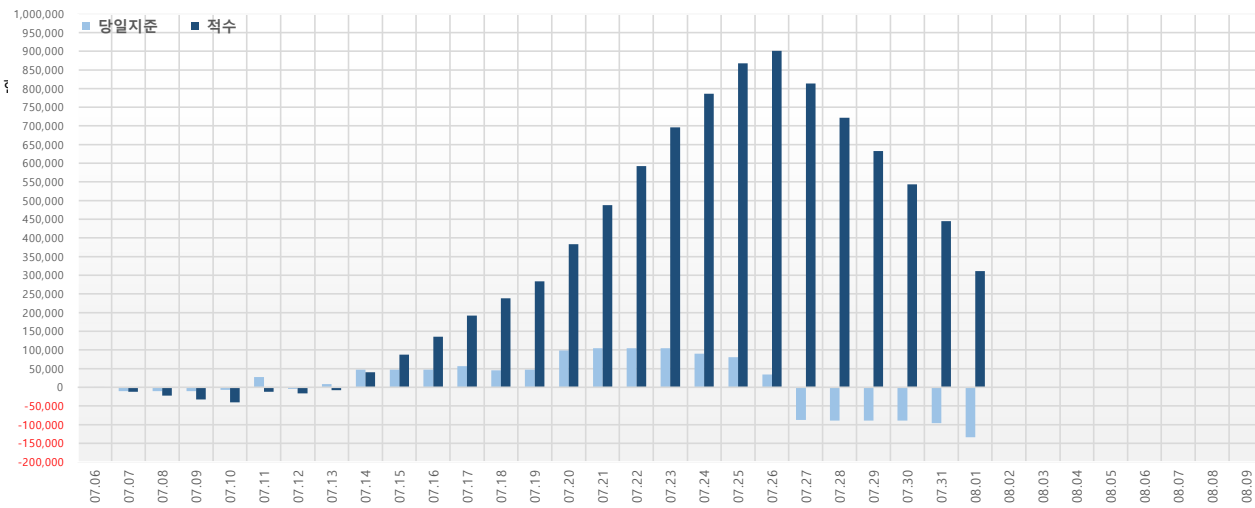


기준금리 추이				단위 : %P	
2023년	2022년	2021년			
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25% (▲0.25)	11.25(목)	1.00% (▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00% (▲0.50)	10.12(화)	0.75% (동결)
08.24(목)	-	08.25(목)	2.50% (▲0.25)	08.26(목)	0.75% (▲0.25)
07.13(목)	3.50% (동결)	07.13(수)	2.25% (▲0.50)	07.15(목)	0.50% (동결)
05.25(목)	3.50% (동결)	05.26(목)	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)	89,916	786,443
07.25(화)	80,988	867,447
07.26(수)	33,905	901,343
07.27(목)	-87,234	813,491
07.28(금)	-89,186	722,104
07.29(토)	-89,186	632,918
07.30(일)	-89,186	543,732
07.31(월)	-95,495	445,235
08.01(화)	-133,650	311,458
08.02(수)		
08.03(목)		
08.04(금)		
08.05(토)		
08.06(일)		
08.07(월)		
08.08(화)		
08.09(수)		