

레포 시장동향

◎ 전일

레포 1일물 롤오버를 제외한 신규 거래 제한적이었으며, 은행 간 콜 조정 후 소폭 잉여 마감하였음.

◎ 금일

국고여유자금 환수 이어져 유동성 축소되는 가운데 은행권 조달니즈 강할 것으로 예상되어 수급 타이트할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.08.09 (수)				2023.08.10 (목)					
재정 (국세환급2.4 실시간0.6)		30,000		한은RP매각 만기(7일)			50,000		
자금조정에금 만기		37,000		재정증권 만기(63일)			15,000		
기타		4,000		공자기금			16,000		
				재정 (교육부5.0 국세환급1.1 실시간0.4)			65,000		
				자금조정에금 만기			39,000		
국고여유자금 환수		-38,000		한은RP매각(7일)			-50,000		
세입		-6,000		통안채 발행(1년), 3.600%			-6,100		
자금조정에금		-39,000		국고채 발행(2년)			-16,000		
				재정증권 발행(63일)			-15,000		
				국고여유자금 환수			-44,000		
				세입			-6,000		
				자금조정에금			-37,000		
전일 기준	지준	-47,700	적수	979	금일 예상	지준	-37,000	적수	-37,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.08.03(목)	180.3	190.7	3.43%	3.500%	3.443%	3.500%	3.73%	3.714%	3.755%
2023.08.04(금)	177.0	190.5	3.45%	3.503%	3.472%		3.72%	3.738%	3.779%
2023.08.07(월)	180.2	189.6	3.51%	3.535%	3.535%		3.72%	3.689%	3.712%
2023.08.08(화)	173.6	187.2	3.51%	3.485%	3.542%		3.70%	3.647%	3.656%
2023.08.09(수)	174.3		3.51%	3.487%	3.541%		3.70%	3.672%	3.691%

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
2023.08.03(목)	14:00~14:10	7	2023.08.10(목)	29.55	3.50%	5.00	16.9%	2023-041-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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	빅토리콘텐츠	문화 콘텐츠 제작 기업	2023.08.07(월) ~ 2023.08.08(화)	2023.08.10(목)	NH (2,440억)
공모주	넥스틸	강판 및 강관 제조 기업	2023.08.09(수) ~ 2023.08.10(목)	2023.08.14(월)	하나
공모주	스마트레이더시스템	4D이미징레이더 전문 기업	2023.08.10(목) ~ 2023.08.11(금)	2023.08.16(수)	대신

관련 정보

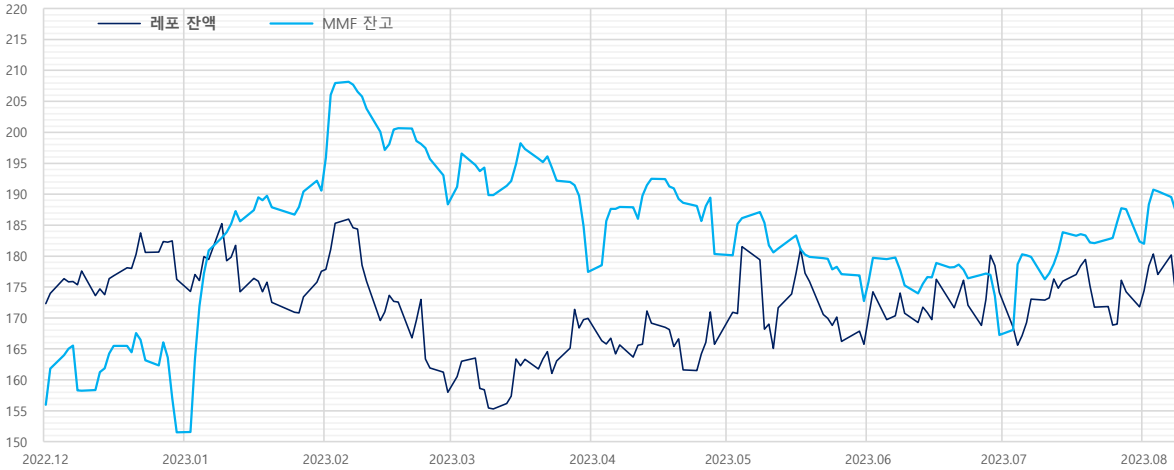
지준일	2023.09.06(수)	금통위	2023.08.24(목)	FOMC	2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수)	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlId=10078655&menuNo=200690
· 한국은행, 공개시장운영 대상기관 선정 (2023.07.27)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlId=10078659&menuNo=200690
· 한국은행, 한국의 금융시장 (2021.12 개정판)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000603/view.do?nttlId=10068266&menuNo=200460
· 2023년 지준 계산·적립기간 및 금통위							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttlId=10074187&menuNo=200295
						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
						무위험치표금리	https://www.kofr.kr
						증권정보포털	https://seibro.or.kr
						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)		06.13(화) ~ 06.14(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)	07.25(화) ~ 07.26(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)		09.19(화) ~ 09.20(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

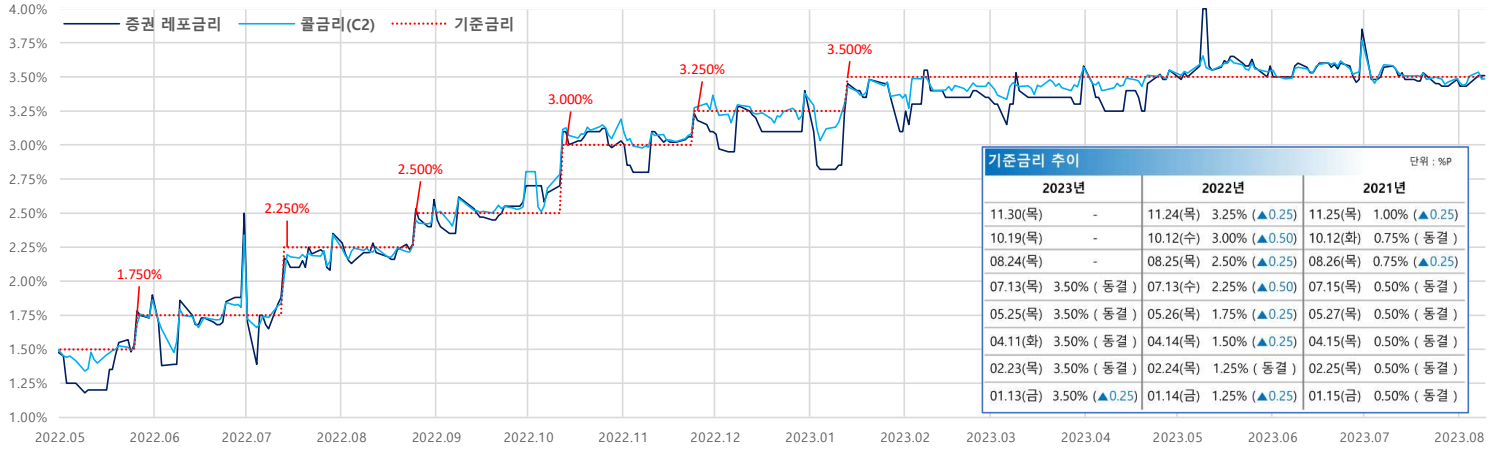
단위: 조 원



월말 MMF 증감내역			
해당연월	MMF	전일대비	전월대비
2023.07.31	182.4	-5.2	15.1
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

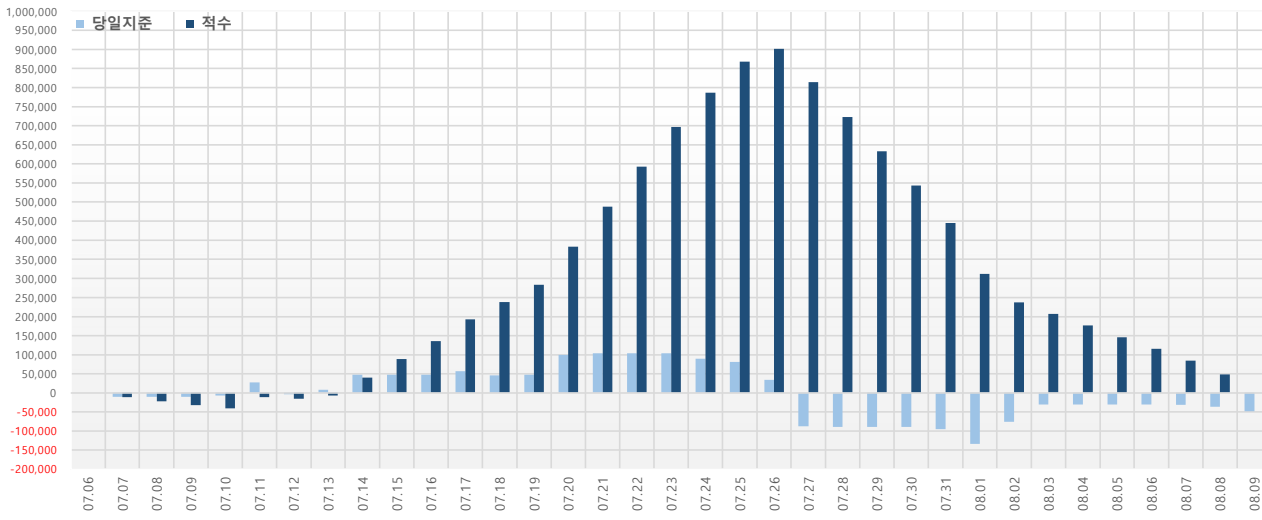


기준금리 추이				단위: %P
2023년	2022년	2021년		
11.30(목)	-	11.24(목)	3.25%	(▲0.25)
10.19(목)	-	10.12(수)	3.00%	(▲0.50)
08.24(목)	-	08.25(목)	2.50%	(▲0.25)
07.13(목)	3.50%	07.13(수)	2.25%	(▲0.50)
05.25(목)	3.50%	05.26(목)	1.75%	(▲0.25)
04.11(화)	3.50%	04.14(목)	1.50%	(▲0.25)
02.23(목)	3.50%	02.24(목)	1.25%	(동결)
01.13(금)	3.50%	01.14(금)	1.25%	(▲0.25)
		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)	-75,721	237,041
08.03(목)	-30,485	206,553
08.04(금)	-30,367	176,641
08.05(토)	-30,367	146,274
08.06(일)	-30,367	115,907
08.07(월)	-31,167	84,620
08.08(화)	-35,937	48,678
08.09(수)	-47,700	979