

레포 시장동향

◎ 전일

운용사 및 신탁 유동성 호전되어 레포금리 하락했으며, 시은 매도 소폭 감소하여 수급 대체로 무난하였음.

◎ 금일

공자기금 유입 및 통안계정 감액 예정되어 있어 조달여건 양호할 것으로 기대되나 시은 매도 규모에 따라 분위기 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2023.08.21 (월) | | | | 2023.08.22 (화) | | | |
|-----------------------|-----------|----------------|-----------|-----------------------|--------------|-----------|-----------------|
| 통안채 증도환매 | | 12,900 | | 통안계정 만기(28일) | | 47,000 | |
| 제기금 | | 3,000 | | 통안채 만기(91일) | | 17,600 | |
| 재정 [국세환급0.3 실시간0.4] | | 7,000 | | 공자기금 | | 22,000 | |
| 자금조정예금 만기 | | 36,000 | | 재정 [국세환급0.3 실시간0.2] | | 5,000 | |
| | | | | 자금조정예금 만기 | | 36,000 | |
| 공자기금 환수 | | -8,000 | | 통안계정(28일) | | -10,000 | |
| 세입 | | -8,000 | | 통안채 발행(91일) | | -13,000 | |
| 자금조정예금 | | -36,000 | | 국고채 발행(5년) | | -22,000 | |
| | | | | 세입 | | -5,000 | |
| | | | | 자금조정예금 | | -36,000 | |
| 전일 기준 | 지준 | -12,713 | 적수 | -516,957 | 금일 예상 | 지준 | 29,000 |
| | | | | | | 적수 | -488,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2023.08.14(월) | 175.2 | 179.8 | 3.58% | 3.580% | 3.597% | 3.500% | 3.69% | 3.747% | 3.796% |
| 2023.08.16(수) | 175.8 | 180.7 | 3.58% | 3.569% | 3.594% | | 3.70% | 3.712% | 3.767% |
| 2023.08.17(목) | 177.0 | 182.6 | 3.56% | 3.557% | 3.576% | | 3.70% | 3.788% | 3.865% |
| 2023.08.18(금) | 176.3 | 182.6 | 3.56% | 3.547% | 3.576% | | 3.70% | 3.729% | 3.804% |
| 2023.08.21(월) | 175.0 | | 3.53% | 3.545% | 3.550% | | 3.70% | 3.795% | 3.863% |

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 |
|---------------|-------------|----|---------------|-------|-------|------|-------|--------------|
| 2023.08.17(목) | 14:00~14:10 | 7 | 2023.08.24(목) | 23.73 | 3.50% | 5.00 | 21.1% | 2023-043-007 |

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정금액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰금액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 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 |
| 2023.08.16(수) | 14:00~14:10 | 27 | 2023.09.12(화) | 1.00 | 1.95 | 3.48% | 1.00 | 2023-0029-0027 |

청약 일정

| 구분 | 청약명 | 업체 | 모집일 | 환불일 | 주간사 / 인수사 (증거금) |
|-----|-------------|----------|-------------------------------|---------------|-----------------|
| 공모주 | 한국제12호스팩 | 기업인수목적회사 | 2023.08.21(월) ~ 2023.08.22(화) | 2023.08.24(목) | 한투 |
| 공모주 | 대신밸런스제15호스팩 | 기업인수목적회사 | 2023.08.21(월) ~ 2023.08.22(화) | 2023.08.24(목) | 대신 |
| 공모주 | 유안타제11호스팩 | 기업인수목적회사 | 2023.08.22(화) ~ 2023.08.23(수) | 2023.08.25(금) | 유안타 |
| 공모주 | 대신밸런스제16호스팩 | 기업인수목적회사 | 2023.08.23(수) ~ 2023.08.24(목) | 2023.08.28(월) | 대신 |

관련 정보

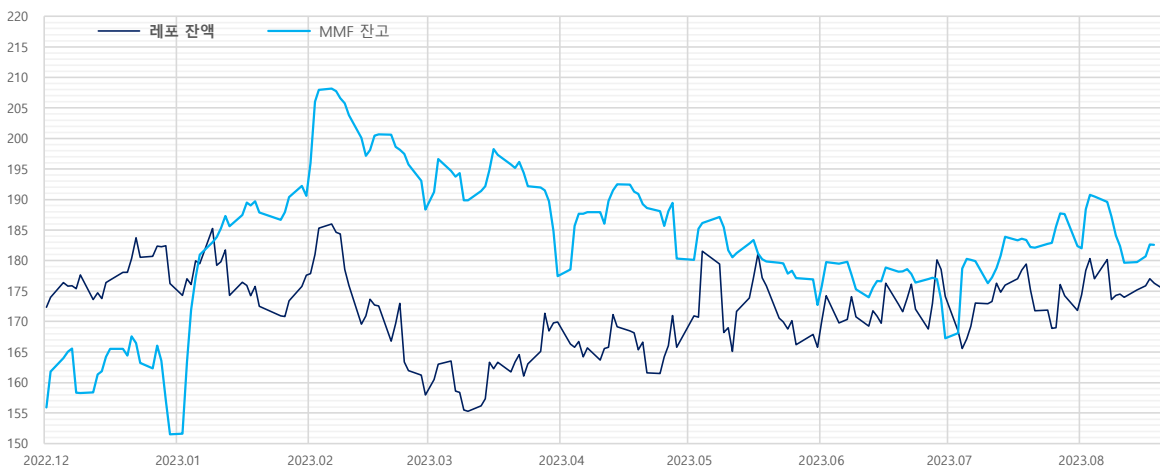
| 지준일 | 2023.09.06(수) | 금통위 | 2023.08.24(목) | FOMC | 2023.09.19(화) ~ 2023.09.20(수) | 한국은행 | http://www.bok.or.kr |
|-------------------------------------|---------------|-----|---------------|------|--|---------|---|
| · 한국은행, 대출제도 개편 방향 (2023.07.27) | | | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttId=10078655&menuNo=200690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

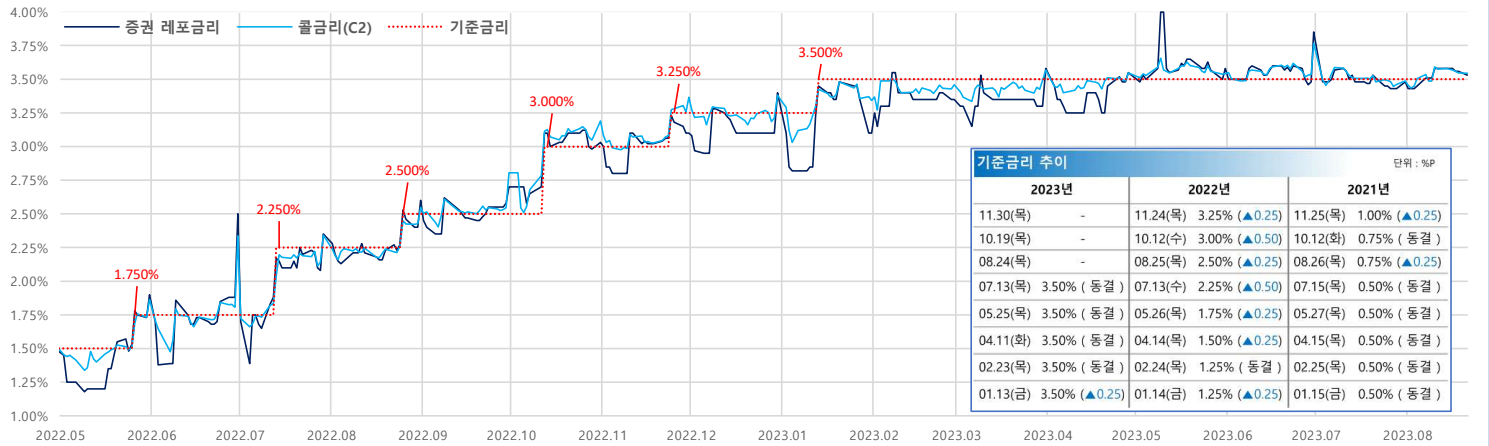
단위 : 조 원



| 해당연월 | 월말일 MMF 증감내역 | | |
|------------|--------------|------|-------|
| | MMF | 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

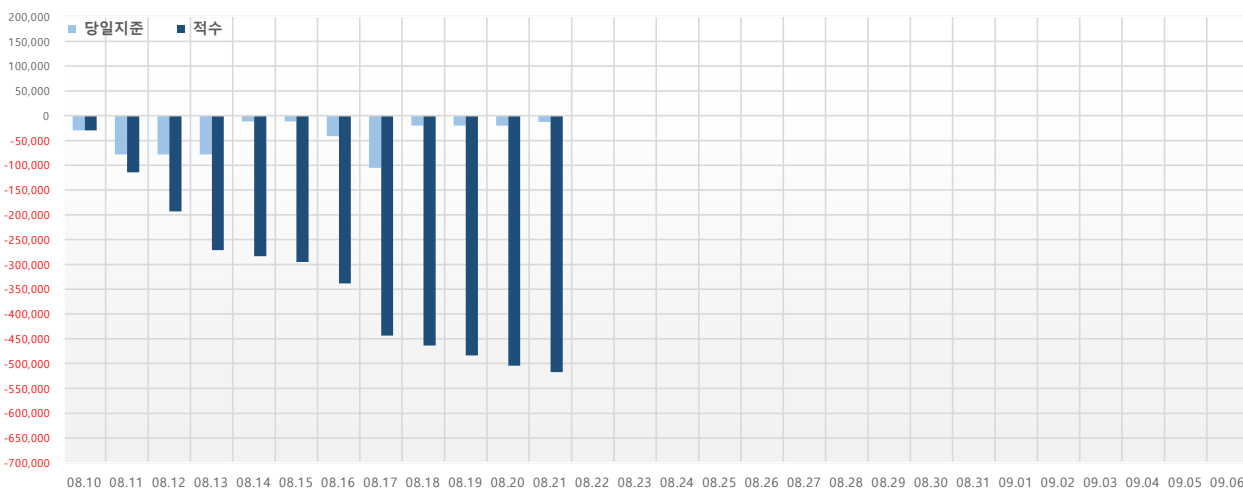


| 기준금리 추이 | | | 단위 : %P | | |
|----------|---------------|----------|---------------|----------|---------------|
| 2023년 | 2022년 | 2021년 | | | |
| 11.30(목) | - | 11.24(목) | 3.25% (▲0.25) | 11.25(목) | 1.00% (▲0.25) |
| 10.19(목) | - | 10.12(수) | 3.00% (▲0.50) | 10.12(화) | 0.75% (동결) |
| 08.24(목) | - | 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(목) | 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 |
|----------|----------|----------|
| 08.10(목) | -29,481 | -29,481 |
| 08.11(금) | -78,460 | -114,153 |
| 08.12(토) | -78,460 | -192,613 |
| 08.13(일) | -78,460 | -271,073 |
| 08.14(월) | -12,000 | -283,073 |
| 08.15(화) | -12,000 | -295,073 |
| 08.16(수) | -40,894 | -338,093 |
| 08.17(목) | -105,064 | -443,125 |
| 08.18(금) | -20,375 | -463,499 |
| 08.19(토) | -20,375 | -483,874 |
| 08.20(일) | -20,375 | -504,249 |
| 08.21(월) | -12,713 | -516,957 |
| 08.22(화) | | |
| 08.23(수) | | |
| 08.24(목) | | |
| 08.25(금) | | |
| 08.26(토) | | |
| 08.27(일) | | |
| 08.28(월) | | |
| 08.29(화) | | |
| 08.30(수) | | |
| 08.31(목) | | |
| 09.01(금) | | |
| 09.02(토) | | |
| 09.03(일) | | |
| 09.04(월) | | |
| 09.05(화) | | |
| 09.06(수) | | |