

레포 시장동향

◎ 전일

공자기금 유입되어 유동성 여전히 풍부했으나 지준 마감 전 1+1일물 매수가 주를 이뤄 2일물 조달 쉽지 않았음.

◎ 금일

전일자 1일물 롤오버를 제외한 신규 거래 제한적이겠으며, 은행권 콜 조정 후 소폭 잉여 마감할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2023.03.07(화) | | | | 2023.03.08(수) | | | | | |
|--------------------------------|-----------|---------|-----------|---|--------------|-----------|---------|-----------|--------|
| 통안채 만기(91일) | | 7,800 | | 재정 [복지부1.1 군급여0.9 국제환급1.1 실시간0.6] | | | 37,000 | | |
| 공자기금 | | 35,000 | | 자금조정예금 만기 | | | 40,000 | | |
| 재정 [국방부0.5 국제환급0.5 실시간0.7] | | 17,000 | | | | | | | |
| 자금조정예금 만기 | | 37,000 | | | | | | | |
| 기타 | | 2,000 | | | | | | | |
| 국고채 발행(30년) | | -35,000 | | 세입 | | | -3,000 | | |
| 국고여유자금 환수 | | -2,000 | | 자금조정예금 | | | -40,000 | | |
| 세입 | | -3,000 | | | | | | | |
| 자금조정예금 | | -40,000 | | | | | | | |
| 전일 기준 | 지준 | 4,262 | 적수 | -20,819 | 금일 예상 | 지준 | 38,000 | 적수 | 17,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2023.02.28(화) | 158.0 | 188.4 | 3.35% | 3.460% | 3.402% | 3.500% | 3.59% | 3.797% | 3.829% |
| 2023.03.02(목) | 160.5 | 191.2 | 3.30% | 3.407% | 3.348% | | 3.61% | 3.878% | 3.907% |
| 2023.03.03(금) | 163.0 | 196.6 | 3.30% | 3.366% | 3.354% | | 3.61% | 3.791% | 3.818% |
| 2023.03.06(월) | 163.5 | 194.7 | 3.15% | 3.337% | 3.243% | | 3.61% | 3.774% | 3.783% |
| 2023.03.07(화) | 158.6 | | 3.30% | 3.428% | 3.376% | | 3.61% | 3.726% | 3.719% |

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

| | | | | | | | | | |
|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 2023.02.23(목) | 3.50% (동결) | 2022.10.12(수) | 3.00% (▲0.50) | 2022.05.26(목) | 1.75% (▲0.25) | 2021.11.25(목) | 1.00% (▲0.25) | 2020.03.17(화) | 0.75% (▼0.50) |
| 2023.01.13(금) | 3.50% (▲0.25) | 2022.08.25(목) | 2.50% (▲0.25) | 2022.04.14(목) | 1.50% (▲0.25) | 2021.08.26(목) | 0.75% (▲0.25) | 2019.10.16(수) | 1.25% (▼0.25) |
| 2022.11.24(목) | 3.25% (▲0.25) | 2022.07.13(수) | 2.25% (▲0.50) | 2022.01.14(금) | 1.25% (▲0.25) | 2020.05.28(목) | 0.50% (▼0.25) | 2019.07.18(목) | 1.50% (▼0.25) |

한국은행 공개시장운영 잔액

◎ RP매입 채안펀드 출자 금융기관 유동성 지원

단위 : 억 원

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정금액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰금액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|--------|-------|-------|-------|--------------|
| 2022.12.16(금) | 11:00~11:10 | 91 | 2023.03.17(금) | 7,500 | 616 | 3.51% | 616 | 2022-058-091 |
| 2023.01.13(금) | 15:00~15:10 | 91 | 2023.04.14(금) | 14,384 | 517 | 3.51% | 517 | 2023-005-091 |
| 2023.01.27(금) | 13:30~13:40 | 91 | 2023.04.28(금) | 23,867 | 1,063 | 3.58% | 1,063 | 2023-010-091 |

◎ RP매각

단위 : 조 원

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 응찰금액 | 금리 | 낙찰금액 | 낙찰률 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|-------|-------|-------|-------|--------------|
| 2023.03.02(목) | 14:00~14:10 | 7 | 2023.03.09(목) | 42.69 | 3.50% | 29.00 | 67.9% | 2023-015-007 |

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정금액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰금액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|----------------|
| 2023.02.14(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2023.03.14(화) | 5.00 | 4.90 | 3.53% | 4.40 | 2023-0007-0028 |
| 2023.02.21(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2023.03.21(화) | 3.00 | 2.13 | 3.55% | 1.53 | 2023-0009-0028 |
| 2023.02.28(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2023.03.28(화) | 9.00 | 9.27 | 3.55% | 9.27 | 2023-0011-0028 |

청약 일정

| 구분 | 청약명 | 업체 | 모집일 | 환불일 | 주간 및 인수사 (증거금) |
|-----|------------|----------|-------------------------------|---------------|----------------|
| 공모주 | 미래에셋트림스팩1호 | 기업인수목적회사 | 2023.03.06(월) ~ 2023.03.07(화) | 2023.03.09(목) | 미래 |
| 공모주 | 유안타제12호스팩 | 기업인수목적회사 | 2023.03.07(화) ~ 2023.03.08(수) | 2023.03.10(금) | 유안타 |

관련 정보

| 기준일 | 2023.03.08(수) | 금통위 | 2023.04.11(화) | FOMC | 2023.03.21(화) ~ 2023.03.22(수) | 한국은행 | http://www.bok.or.kr |
|---|---------------|-----|---------------|--|-------------------------------|---------|---|
| · 한국은행, 단기금융시장 안정화 조치 시행 (2022.10.27) | | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlId=10073499&menuNo=200690 | | 경제통계시스템 | https://ecos.bok.or.kr |
| · 한국은행, 단기금융시장 안정화 조치 연장 시행 (2023.01.13) | | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttlId=10074981&menuNo=200690 | | 무위험지표금리 | https://www.kofr.kr |
| · 한국은행, 최근 단기금융 및 채권 시장 불안과 한국은행의 시장안정화 조치 (2022.12.26) | | | | www.bok.or.kr/portal/bbs/B0000347/view.do?nttlId=10074403&menuNo=201106 | | 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 |

기준 계산·적립기간, 금통위 및 FOMC

| | 기준 계산기간 | | 기준 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) | 06.13(화) ~ 06.14(수) |
| 2023년 7월 | 07.01(토) | 07.31(월) | 08.10(목) | 09.06(수) | 07.13(목) | 07.27(목) | | 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) | | 10.31(화) ~ 11.01(수) |
| 2023년 11월 | 11.01(수) | 11.30(목) | 12.07(목) | 2024.01.10(수) | 11.30(목) | 11.09(목) | | |
| 2023년 12월 | 12.01(금) | 12.31(일) | 2024.01.11(목) | 2024.02.07(수) | | 12.14(목) | 12.28(목) | 12.12(화) ~ 12.13(수) |

한국은행 시장안정화 조치

◎ RP매입 단기금융시장 안정화 조치

단위 : 조 원

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정금액 | 응찰금액 | 금리 | 낙찰금액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|------|------|-------|------|--------------|
| 2022.11.21(월) | 11:00~11:10 | 14 | 2022.12.05(월) | 2.50 | 3.60 | 3.29% | 2.50 | 2022-051-014 |
| 2022.12.05(월) | 11:00~11:10 | 14 | 2022.12.19(월) | 3.50 | 3.30 | 3.32% | 2.60 | 2022-054-014 |
| 2022.12.12(월) | 11:00~11:10 | 28 | 2023.01.09(월) | 3.00 | 2.12 | 3.58% | 1.53 | 2022-056-028 |
| 2022.12.19(월) | 11:00~11:10 | 28 | 2023.01.16(월) | 3.50 | 4.16 | 3.64% | 3.50 | 2022-059-028 |
| 2022.12.28(수) | 11:00~11:10 | 28 | 2023.01.25(수) | 2.50 | 2.00 | 3.70% | 2.00 | 2022-061-028 |
| 2023.01.09(월) | 11:00~11:10 | 7 | 2023.01.16(월) | 1.00 | 0.30 | 3.30% | 0.30 | 2023-002-007 |
| 2023.01.16(월) | 11:00~11:10 | 9 | 2023.01.25(수) | 1.00 | 0.30 | 3.60% | 0.30 | 2023-006-009 |
| 2023.01.25(수) | 11:00~11:10 | 12 | 2023.02.06(월) | 1.00 | 0.50 | 3.70% | 0.50 | 2023-008-012 |

◎ RP매입 채안펀드 출자 금융기관 유동성 지원

단위 : 억 원

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정금액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰금액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|--------|-------|-------|-------|--------------|
| 2022.12.16(금) | 11:00~11:10 | 91 | 2023.03.17(금) | 7,500 | 616 | 3.51% | 616 | 2022-058-091 |
| 2023.01.13(금) | 15:00~15:10 | 91 | 2023.04.14(금) | 14,384 | 517 | 3.51% | 517 | 2023-005-091 |
| 2023.01.27(금) | 13:30~13:40 | 91 | 2023.04.28(금) | 23,867 | 1,063 | 3.58% | 1,063 | 2023-010-091 |

단기금융시장 금리 추이

