

레포 시장동향

◎ 전일

국고채 만기에 앞서 대규모 공자기금 환수되어 금리 급등했으나 은행권 매도 감소하여 수급 원활하였음.

◎ 금일

당일기준 대폭 잉여 전환되어 조달여건 개선될 것으로 기대됨. 은행권 운용 및 조달 강도에 따라 장중 금리 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.03.09 (목)				2023.03.10 (금)				
한은RP매각 만기(7일)	290,000	국고채 만기 [24.5] 및 이자 [6.2]	307,000					
통안채 만기(1년)	16,100	재정 [국채환급0.6 실시간0.6]	12,000					
재정 [기재부2.8 국채환급0.5 실시간1.3]	44,000	자금조정예금 만기	40,000					
자금조정예금 만기	49,000							
요지준 변동분	11,000							
기타	16,000							
한은RP매각(7일)	-290,000	국고채 한은 보유분	-14,000					
통안채 발행(1년)	-11,600	공자기금 환수	-6,000					
재정증권 발행(63일)	-10,000	세입	-3,000					
공자기금 환수 [운용7.7 환수38.3]	-306,000	자금조정예금	-40,000					
세입	-4,000							
자금조정예금	-40,000							
전일 기준	지준	-219,150	적수	금일 예상	지준	77,000	적수	-142,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.03.03(금)	163.0	196.6	3.30%	3.366%	3.354%	3.500%	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	193.7	3.30%	3.428%	3.376%		3.61%	3.726%	3.719%
2023.03.08(수)	158.4	194.3	3.30%	3.458%	3.376%		3.61%	3.855%	3.822%
2023.03.09(목)	155.5		3.53%	3.440%	3.552%		3.61%	3.858%	3.817%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2023.02.23(목)	3.50% (동 결)	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 제안펀드 출자 금융기관 유통성 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
2023.03.09(목)	14:00~14:10	7	2023.03.16(목)	34.98	3.50%	29.00	82.9%	2023-016-007

◎ 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	유안타제12호스팩	기업인수목적회사	2023.03.07(화) ~ 2023.03.08(수)	2023.03.10(금)	유안타

관련 정보

· 한국은행, 단기금융시장 안정화 조치 시행 (2022.10.27)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttId=10073499&menuNo=200690	한국은행	http://www.bok.or.kr
· 한국은행, 단기금융시장 안정화 조치 연장 시행 (2023.01.13)	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttId=10074981&menuNo=200690	경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
· 한국은행, 최근 단기금융 및 채권 시장 불안과 한국은행의 시장안정화 조치 (2022.12.2)	www.bok.or.kr/portal/bbs/B0000347/view.do?nttId=10074403&menuNo=201106	무위험지표금리	https://www.kofr.kr
· 2023년 기준 계산·적립기간 및 금통위	www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttId=10074187&menuNo=200295	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)	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



당일지준 및 적수 추이

단위 : 억 원

