

레포 시장동향

◎ 전일
MMF 설정과 건보자금 유입으로 유동성 풍부했으며, 통안계정 증액에도 은행권 조달 많지 않아 잉여세 지속되었음.

◎ 금일
당일기준 및 적수 양호하여 은행권 매도 제한적이겠으며, 주중 잉여세 심화되는 가운데 조달금리 하락할 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

| 2023.03.14 (화) | | 2023.03.15 (수) | |
|--------------------------------|------------------|--------------------------------|------------------|
| 통안계정 만기(28일) | 44,000 | 공자기금 | 7,000 |
| 통안채 만기(91일) | 3,000 | 재정 [복지부1.8 국세환급0.5 실시간0.6] | 29,000 |
| 공자기금 | 5,000 | 자금조정예금 만기 | 43,000 |
| 재정 [교육부6.0 국세환급0.4 실시간0.8] | 72,000 | | |
| 자금조정예금 만기 | 47,000 | | |
| 기타 | 10,000 | | |
| 통안계정(28일) | -104,000 | 국고채 발행(2년) | -20,000 |
| 통안채 발행(91일) | -12,600 | 국고여유자금 환수 | -2,000 |
| 국고채 발행(3년) | -28,000 | 제기금 환수 | -2,000 |
| 제기금 환수 | -2,000 | 세입 | -4,000 |
| 원천세 | -51,000 | 자금조정예금 | -45,000 |
| 자금조정예금 | -43,000 | | |
| 전일 기준 | 지준 19,084 | 적수 70,782 | 금일 예상 |
| | | | 지준 25,000 |
| | | | 적수 96,000 |

Market Data

단위 : 조 원

| | 레포 거래잔액 | MMF 잔고 | 레포금리 | 콜금리(C2) | KOFR | 기준금리 | CD(91일) | 국고채(3년) | 국고채(5년) |
|---------------|---------|--------|-------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|
| 2023.03.08(수) | 158.4 | 194.3 | 3.30% | 3.458% | 3.376% | 3.500% | 3.61% | 3.855% | 3.822% |
| 2023.03.09(목) | 155.5 | 189.8 | 3.53% | 3.440% | 3.552% | | 3.61% | 3.858% | 3.817% |
| 2023.03.10(금) | 155.3 | 189.9 | 3.40% | 3.429% | 3.442% | | 3.61% | 3.703% | 3.617% |
| 2023.03.13(월) | 156.2 | 191.4 | 3.35% | 3.435% | 3.400% | | 3.61% | 3.435% | 3.398% |
| 2023.03.14(화) | 157.4 | | 3.35% | 3.416% | 3.404% | | 3.61% | 3.381% | 3.344% |

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 |
|---------------|-------------|----|---------------|-------|-------|-------|-------|--------------|
| 2023.03.09(목) | 14:00~14:10 | 7 | 2023.03.16(목) | 34.98 | 3.50% | 29.00 | 82.9% | 2023-016-007 |

◎ 통화안정결제예치금

단위 : 조 원

| 입찰일 | 입찰시간 | 기일 | 만기일 | 예정금액 | 응찰금액 | 낙찰금리 | 낙찰금액 | 회차번호 |
|---------------|-------------|----|---------------|-------|-------|-------|-------|----------------|
| 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 |
| 2023.03.14(화) | 14:00~14:10 | 28 | 2023.04.11(화) | 10.00 | 12.30 | 3.53% | 10.40 | 2023-0012-0028 |

청약 일정

| 구분 | 청약명 | 업체 | 모집일 | 환불일 | 주간 및 인수사 (증거금) |
|-----|---------|-----------------|-------------------------------|---------------|------------------|
| 공모주 | 한화리츠 | 부동산 개발 및 공급업 | 2023.03.13(월) ~ 2023.03.14(화) | 2023.03.16(목) | 한투, 한화, SK (91억) |
| 실권주 | 이브이첨단소재 | 연성회로기판 및 필름 제조업 | 2023.03.13(월) ~ 2023.03.14(화) | 2023.03.16(목) | 유진 |

관련 정보

| 지준일 | 2023.04.05(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?nttid=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?nttid=10074981&menuNo=200690 | | 무위험지표금리 | https://www.kofr.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 | | 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 |

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) | |
| 2023년 7월 | 07.01(토) | 07.31(월) | 08.10(목) | 09.06(수) | 07.13(목) | 07.27(목) | | 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) | | 09.14(목) | 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) | |

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



당일기준 및 적수 추이

단위 : 억 원

