

Repo Market Report

2023.03.17 (금)



자금시장부 6021-5832

레포 시장동향

- ◎ 전일
한은RP매각 규모 확대됐으나 입찰 후에도 은행권 매도 많지 않았으며, 장중 잉여세 심화되어 거래금리 하락하였음.
- ◎ 금일
건보자금 유효한 가운데 MMF 설정 및 재정 유입으로 시장 잉여세 계속되었음. 당일기준 부족폭 축소되어 은행권 조달 제한적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.03.16 (목)				2023.03.17 (금)			
한은RP매각 만기(7일)		290,000		공자기금			8,000
재정 [복지부1.4 국세환급0.6 실시간0.8]		28,000		재정 [복지부1.6 교육부0.5 경찰청0.5 국세환급1.0 실시간1.2]			48,000
자금조정예금 만기		39,000		자금조정예금 만기			40,000
기타		3,000					
한은RP매각(7일)		-350,000		한은RP매입 만기(91일)			-616
통안채 발행(3년)		-14,800		국고채 비경쟁인수			-8,000
재정증권 발행(63일)		-10,000		세입			-10,000
세입		-7,000		자금조정예금			-40,000
자금조정예금		-40,000					
전일 기준	지준	-42,040	적수	48,514	금일 예상	지준	-5,000
						적수	44,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.03.10(금)	155.3	189.9	3.40%	3.429%	3.442%	3.500%	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	192.1	3.35%	3.416%	3.404%		3.61%	3.381%	3.344%
2023.03.15(수)	163.3	194.9	3.35%	3.370%	3.393%		3.61%	3.473%	3.424%
2023.03.16(목)	162.3		3.35%	3.439%	3.387%		3.62%	3.400%	3.364%

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 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
2023.03.16(목)	14:00~14:10	7	2023.03.23(목)	45.08	3.50%	35.00	77.6%	2023-017-007

◎ 통화안정계정예치금

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	엘비인베스트먼트	벤처캐피탈	2023.03.20(월) ~ 2023.03.21(화)	2023.03.23(목)	미래
공모주	지아이이노베이션	면역치료제 개발 바이오기업	2023.03.21(화) ~ 2023.03.22(수)	2023.03.24(금)	NH, 하나, 삼성

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 (2022.12.26)					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	한은RP매각	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)	02.23(목)	02.09(목)		
2023년 3월		03.01(수)	03.31(금)	04.06(목)	04.05(수)	03.09(목)	03.23(목)	03.21(화) ~ 03.22(수)
2023년 4월	건보자금 유	04.30(일)	05.11(목)	05.07(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)	
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)	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



당일기준 및 적수 추이

단위 : 억 원

