

Repo Market Report

2023.03.27 (월)



자금시장부 6021-5832

레포 시장동향

◎ 전주
 잉여 분위가 지속되어 주간 시작금리 3.35% 유지되었고, 장중 금리 하락세 보임.
 건보자금 이탈에도 운용사 및 신탁 유동성 풍부했으며, 외은 매수에 적극적이었음.
 주중 일부 시은 저금리 매도 있었으나 콜차입과 마찬가지로 그 규모는 제한적이었음.

◎ 금일
 별다른 매수 이탈요인 없어 잉여세 유지되겠으며, 은행권 조달 강도에 따라 장중 금리 가변적일 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.03.24 (금)				2023.03.27 (월)				
공자기금		10,000		재정 [국세환급0.1 실시간1.9]			20,000	
재정 [국세환급0.1 실시간1.3]		14,000		자금조정예금 만기			51,000	
자금조정예금 만기		49,000						
국고채 비경쟁인수		-10,000		세입			-5,000	
세입		-4,000		자금조정예금			-50,000	
자금조정예금		-51,000						
기타		-2,000						
전일 기준	지준	-56,302	적수	금일 예상	지준	-40,000	적수	-466,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.03.20(월)	161.8	195.8	3.35%	3.479%	3.387%		3.62%	3.264%	3.257%
2023.03.21(화)	163.4	195.2	3.35%	3.464%	3.389%		3.62%	3.294%	3.274%
2023.03.22(수)	164.6	196.1	3.35%	3.433%	3.381%	3.500%	3.62%	3.284%	3.262%
2023.03.23(목)	161.1	194.3	3.35%	3.450%	3.397%		3.62%	3.206%	3.186%
2023.03.24(금)	163.0		3.35%	3.419%	3.390%		3.59%	3.160%	3.159%

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	입찰금리	낙찰금액	회차번호
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
2023.03.17(금)	14:00~14:10	28	2023.04.14(금)	-	16	3.50%	16	2023-018-028

◎ RP매각

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.03.23(목)	14:00~14:10	7	2023.03.30(목)	62.02	3.50%	36.50	58.9%	2023-019-007

◎ 통화안정계정예치금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
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
2023.03.21(화)	14:00~14:10	28	2023.04.18(화)	10.00	10.45	3.55%	10.15	2023-0013-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간 및 인수사 (증거금)
공모주	하나27호스팩	기업인수목적회사	2023.03.27(월) ~ 2023.03.28(화)	2023.03.30(목)	하나
공모주	IBKS제22호스팩	기업인수목적회사	2023.03.27(월) ~ 2023.03.28(화)	2023.03.30(목)	IBK
공모주	삼성FN리츠	부동산투자신탁	2023.03.27(월) ~ 2023.03.28(화)	2023.03.30(목)	삼성, 한투, KB, NH
공모주	미래에셋벤티전스팩3호	기업인수목적회사	2023.03.28(화) ~ 2023.03.29(수)	2023.03.31(금)	미래

관련 정보

지준일	2023.04.05(수)	금통위	2023.04.11(화)	FOMC	2023.05.02(화) ~ 2023.05.03(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
· 한국은행, 단기금융시장 안정화 조치 연장 시행 (2023.01.13)							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttId=10074981&menuNo=200690
· 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
· 2023년 지준 계산·적립기간 및 금통위							www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttId=10074187&menuNo=200295
						경제통계시스템	https://ecos.bok.or.kr
						무위험지표금리	https://www.kofr.kr
						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)	
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)	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)	

한국은행 시장안정화 조치

◎ RP매입 단기금융시장 안정화 조치

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	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 채안판드 출자 금융기관 유동성 지원

단위 : 억 원

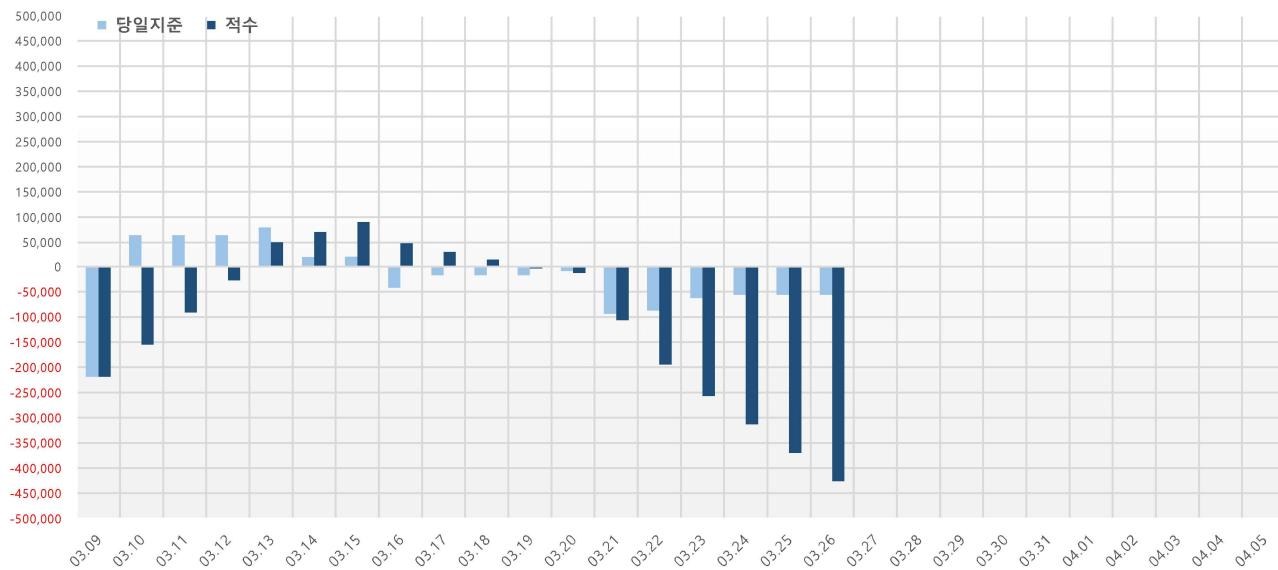
입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	입찰금리	낙찰금액	회차번호
2022.12.16(금)	11:00~11:10	91	2023.03.17(금)	7,500	616	3.51%	616	2022-058-091
2023.01.13(금)	15:00~15:10	91	2023.04.14(금)	14,384	517	3.51%	517	2023-005-091
2023.01.27(금)	13:30~13:40	91	2023.04.28(금)	23,867	1,063	3.58%	1,063	2023-010-091
2023.03.17(금)	14:00~14:10	28	2023.04.14(금)	-	16	3.50%	16	2023-018-028

단기금융시장 금리 추이



당일지준 및 적수 추이

단위 : 억 원



	당일지준	적수
03.09(목)	-219,150	-219,150
03.10(금)	63,996	-155,150
03.11(토)	63,996	-91,154
03.12(일)	63,996	-27,158
03.13(월)	79,387	50,307
03.14(화)	19,084	70,782
03.15(수)	19,773	90,555
03.16(목)	-42,040	48,514
03.17(금)	-17,483	31,035
03.18(토)	-17,483	13,552
03.19(일)	-17,483	-3,931
03.20(월)	-8,864	-12,795
03.21(화)	-93,899	-106,700
03.22(수)	-87,704	-194,404
03.23(목)	-62,661	-257,067
03.24(금)	-56,302	-313,263
03.25(토)	-56,302	-369,565
03.26(일)	-56,302	-425,867
03.27(월)		
03.28(화)		
03.29(수)		
03.30(목)		
03.31(금)		
04.01(토)		
04.02(일)		
04.03(월)		
04.04(화)		
04.05(수)		