

Repo Market Report

2023.04.17 (월)



자금시장부 6021-5832

레포 시장동향

◎ 전주

주초 유동성 풍부하여 익일물 및 기일물 금리 낮게 유지되었고, 회사채 매도 원활하였음.
은행권 매도 꾸준했으나 원천세 및 배당금 이슈로 자금 이탈하여 수급 점차 타이트해짐.
주말 앞두고 자금경색 우려로 시작금리 급등했으며, 주간 거래량 소폭 증가세를 보임.

◎ 금일

별다른 변동요인 없어 전일과 비슷한 양상 보이겠으며, 은행권 조달 강도에 따라 부족세 결정될 전망.

지준 증감 요인

단위 : 억 원

2023.04.14 (금)				2023.04.17 (월)					
한은RP매입(14일)		33	제기금				1,000		
공자기금		10,000	재정 [복지부1.0 실시간1.6]				26,000		
제기금		5,000	자금조정예금 만기				36,000		
재정 [복지부1.0 실시간1.5]		25,000							
자금조정예금 만기		37,000							
한은RP매입 만기(91일)		-517	공자기금 환수				-11,000		
한은RP매입 만기(28일)		-16	국고채 발행(50년)				-5,000		
국고채 비경쟁인수		-10,000	세입				-5,000		
세입		-5,000	자금조정예금				-36,000		
자금조정예금		-36,000							
전일 기준	지준	-56,967	적수	-889,566	금일 예상	지준	-51,000	적수	-1,054,000

Market Data

단위 : 조 원

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	KOFR	기준금리	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.04.10(월)	163.7	187.9	3.25%	3.419%	3.312%	3.500%	3.51%	3.192%	3.165%
2023.04.11(화)	165.6	186.0	3.25%	3.452%	3.313%		3.48%	3.231%	3.191%
2023.04.12(수)	165.7	189.8	3.25%	3.430%	3.313%		3.43%	3.233%	3.214%
2023.04.13(목)	171.1	191.5	3.25%	3.438%	3.308%		3.43%	3.199%	3.194%
2023.04.14(금)	169.1		3.40%	3.491%	3.439%		3.43%	3.215%	3.203%

한국은행 기준금리 추이

단위 : %P

2023.04.11(화)	3.50% (동 결)	2022.11.24(목)	3.25% (▲0.25)	2022.07.13(수)	2.25% (▲0.50)	2022.02.24(목)	1.25% (동 결)	2021.08.26(목)	0.75% (▲0.25)
2023.02.23(목)	3.50% (동 결)	2022.10.12(수)	3.00% (▲0.50)	2022.05.26(목)	1.75% (▲0.25)	2022.01.14(금)	1.25% (▲0.25)	2020.05.28(목)	0.50% (▼0.25)
2023.01.13(금)	3.50% (▲0.25)	2022.08.25(목)	2.50% (▲0.25)	2022.04.14(목)	1.50% (▲0.25)	2021.11.25(목)	1.00% (▲0.25)	2020.03.17(화)	0.75% (▼0.50)

한국은행 공개시장운영 잔액

◎ RP매입 채안펀드 출자 금융기관 유동성 지원

단위 : 억 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	매입금리	낙찰금액	회차번호
2023.01.27(금)	13:30~13:40	91	2023.04.28(금)	23,867	1,063	3.58%	1,063	2023-010-091
2023.04.14(금)	14:00~14:10	14	2023.04.28(금)	-	33	3.50%	33	2023-023-014

◎ RP매각

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2023.04.11(화)	14:00~14:10	9	2023.04.20(목)	45.14	3.50%	29.50	65.4%	2023-022-009

◎ 통화안정예금

단위 : 조 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2023.03.21(화)	14:00~14:10	28	2023.04.18(화)	10.00	10.45	3.55%	10.15	2023-0013-0028
2023.03.28(화)	14:00~14:10	28	2023.04.25(화)	5.00	9.45	3.48%	5.00	2023-0014-0028
2023.04.11(화)	15:00~15:10	28	2023.05.09(화)	6.00	3.65	3.52%	3.65	2023-0015-0028

청약 일정

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간 및 인수사 (증거금)
공모주	마이크로투나노	반도체 제조업	2023.04.17(월) ~ 2023.04.18(화)	2023.04.20(목)	한투
실권주	젠큐릭스	의료용품 및 의약 제품 제조업	2023.04.17(월) ~ 2023.04.18(화)	2023.04.20(목)	한투
공모주	토마토시스템	소프트웨어 개발 솔루션 기업	2023.04.18(화) ~ 2023.04.19(수)	2023.04.21(금)	교보

관련 정보

지준일	2023.05.10(수)	금통위	2023.05.25(목)	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)	04.13(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 채안펀드 출자 금융기관 유동성 지원

단위 : 억 원

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	매입금리	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
2023.04.14(금)	14:00~14:10	14	2023.04.28(금)	-	33	3.50%	33	2023-023-014

단기금융시장 금리 추이



당일지준 및 적수 추이

단위 : 억 원

