

레포 시장동향

◎ 전일

지난 월말 실시한 한은RP매입 만기 도래했으나 국고금 유입으로 유동성 회복되어 금리 하루만에 원복됨. 장중 잉여세 심화되어 거래금리 지속 하락하였음.

◎ 금일

한은 통화정책으로 유동성 흡수하겠으나 국고금 추가 유입되어 레포 조달여건 양호할 전망. 연말대비 기일을 종료되어 익일물 및 짧은 기일물 매도 증가 기대됨.

지준 변동요인

(단위 : 조원)

2023.01.02(월) 지준 증감 요인					2023.01.03(화) 지준 증감 추정				
국고여유자금			45,000		통안채 만기(91일)			10,100	
공자기금			8,000		국고여유자금			68,000	
통안채 이자			3,000		공자기금			22,000	
자금조정예금 만기			47,000		금융중개지원대출			3,000	
기타			9,000		재정			2,000	
					자금조정예금 만기			43,000	
한국은행 RP매입 만기(3일)			-84,000		통안계정(28일)			-70,000	
금융중개지원대출 만기			-3,000		통안채 발행(91일)			-7,700	
제기금 환수			-6,000		국고채 발행(30년)			-23,000	
세입			-15,000		제기금 환수			-4,000	
자금조정예금			-43,000		월말세입			-65,000	
					자금조정예금			-43,000	
전일 기준	지준	100,539	적수	457,680	금일 예상	지준	36,000	적수	493,000

Market Data

(단위 : 조원)

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	KOFR	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2022.12.27(화)	182.4	166.1	3.10%	3.252%	3.25%	3.153%	3.98%	3.662%	3.646%
2022.12.28(수)	182.3	163.6	3.10%	3.187%		3.160%	3.98%	3.668%	3.676%
2022.12.29(목)	182.4	157.1	3.10%	3.212%		3.209%	3.98%	3.719%	3.745%
2022.12.30(금)	176.2	151.5	3.40%	3.380%		3.479%	3.98%	3.722%	3.743%
2023.01.02(월)	174.3		3.10%	3.291%		3.189%	3.98%	3.782%	3.809%

한국은행 공개시장운영 잔액

(단위 : 조원)

◎ RP매입

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2022.12.12(월)	11:00~11:10	28	2023.01.09(월)	2.12	3.58%	1.53	72.2%	2022-056-028
2022.12.16(금)	11:00~11:10	91	2023.03.17(금)	616억	3.51%	616억	100.0%	2022-058-091
2022.12.19(월)	11:00~11:10	28	2023.01.16(월)	4.16	3.64%	3.50	84.1%	2022-059-028
2022.12.28(수)	11:00~11:10	28	2023.01.25(수)	2.00	3.70%	2.00	100.0%	2022-061-028
2022.12.30(금)	14:00~14:10	3	2023.01.02(월)	8.40	3.25%	8.40	100.0%	2022-063-003

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회차번호
2022.12.29(목)	14:00~14:10	7	2023.01.05(목)	58.07	3.25%	20.00	34.4%	2022-062-007

◎ 통화안정예정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회차번호
2022.12.13(화)	14:00~14:10	28	2023.01.10(화)	2.00	1.78	3.28%	1.78	2022-0052-0028
2022.12.20(화)	14:00~14:10	28	2023.01.17(화)	2.50	2.60	3.28%	2.50	2022-0054-0028
2022.12.27(화)	14:00~14:10	29	2023.01.25(수)	2.50	4.24	3.30%	3.00	2022-0055-0029

청약 일정

(단위 : 조원)

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간 및 인수사(증거금)	비고
공모주	한주라이트메탈	금속 가공제품 제조업	2023.01.10(화) ~ 2023.01.11(수)	2023.01.13(금)	미래, 현대차, 유진	
공모주	TEMCO	반도체 특수가스 제조업	2023.01.10(화) ~ 2023.01.11(수)	2023.01.13(금)	한화	
공모주	오브젠	마케팅 솔루션 개발업	2023.01.16(월) ~ 2023.01.17(화)	2023.01.19(목)	한투	
공모주	미래반도체	반도체 개발업	2023.01.16(월) ~ 2023.01.17(화)	2023.01.19(목)	신한	
공모주	샌즈랩	사이버 보안 업체	2023.01.16(월) ~ 2023.01.17(화)	2023.01.19(목)	키움	

관련 정보

지준일	2023.01.11(수)	금통위	2023.01.13(금)	FOMC	2023.01.31(화) ~ 2023.02.01(수)
· 한국은행, 단기금융시장 안정화 조치 시행 (2022.12.16) www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttId=10073499&menuNo=200690					
· 한국은행, 채안펀드 출자 금융기관 유동성 지원을 위한 RP매입 공고 (2022.10.27) www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttId=10074408&menuNo=200295					
· 한국은행, 2023년 1월 통화안정증권 발행 계획 (2022.12.29) www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttId=10074684&menuNo=200295					
· 기재부, 2023년 국고채 발행계획 (2022.12.26) www.korea.kr/news/pressReleaseView.do?newsId=156544688					

참고

한국은행 <http://www.bok.or.kr> 경제통계시스템 <https://ecos.bok.or.kr> 무위험지표금리 <https://www.kofr.kr> 증권정보포털 <https://seibro.or.kr> 금융투자협회 <https://kofiafond.or.kr>
2023년 지준 계산·적립기간 및 금융위 www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttId=10074187&menuNo=200295&pageIndex=1