

레포 시장동향

◎ 전일

기 유입된 유동성 풍부하여 금리 낮게 출발했으나 한은RP매각 증액 영향으로 은행권 매도 수요 증가하면서 잉여세 완화되었음.

◎ 금일

국고금 유출입 혼재하나 운용사 및 은행신탁 매수세 계속되었음. 은행권 매도 강도에 따라 장중 금리 낙폭 가변적일 전망.

지준 증감 요인

(단위 : 억 원)

2023.01.05(목)				2023.01.06(금)					
한국은행RP매각 만기(7일)		200,000		공자기금		15,000			
국고여유자금		33,000		재정 [국세환급1.3 군급여1.3]		26,000			
제기금		12,000		자금조정예금 만기		39,000			
재정		1,000							
자금조정예금 만기		41,000							
기타		7,000							
한국은행RP매각(8일)		-280,000		국고여유자금 환수		-25,000			
공자기금 환수		-23,000		제기금 환수		-8,000			
통안채 발행(2년)		-26,400		국고채 비경쟁인수		-5,000			
국고채 발행(30년)		-2,000		자금조정예금		-40,000			
세입		-4,000							
자금조정예금		-39,000							
전일 기준	지준	-71,258	적수	413,390	금일 예상	지준	-73,000	적수	340,000

Market Data

(단위 : 조 원)

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	KOFR	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
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	151.6	3.10%	3.291%		3.189%	3.98%	3.782%	3.809%
2023.01.03(화)	177.0	163.4	2.85%	3.119%	3.25%	2.981%	3.96%	3.661%	3.674%
2023.01.04(수)	176.0	171.9	2.82%	3.032%		2.954%	3.96%	3.632%	3.616%
2023.01.05(목)	179.9		2.82%	3.075%		2.925%	3.96%	3.644%	3.607%

한국은행 공개시장운영 잔액

(단위 : 조 원)

◎ RP매입

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회사번호
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

◎ RP매각

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회사번호
2023.01.05(목)	14:00~14:10	8	2023.01.13(금)	47.50	3.25%	28.00	58.9%	2023-001-008

◎ 통화안정증권예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회사번호
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
2023.01.03(화)	14:00~14:10	28	2023.01.31(화)	1.00	2.35	3.38%	1.20	2023-0001-0028
	14:30~14:40	14	2023.01.17(화)	6.00	10.85	3.25%	7.20	2023-0002-0014

청약 일정

(단위 : 조 원)

구분	청약명	업체	모집일	환불일	주간 및 인수사(증거금)	비고
실권주	제넥신	신약 연구개발업	2023.01.05(목) ~ 2023.01.06(금)	2023.01.10(화)	한투	
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	

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://kofiabond.or.kr>
 2023년 지준 계산·적립기간 및 금통위 www.bok.or.kr/portal/bbs/P0001773/view.do?nttid=10074187&menuNo=200295&pageIndex=1