

레포 시장동향

- ◎ 전일
국고여유자금 추가 유입되어 조달여건 양호했으나 지준 마감일 전일자 익일물 롤오버를 제외한 신규 매도 많지 않았음.
- ◎ 금일
원천세 납부에 상응하는 재정 및 국고금 유입 예정되어 있으나 명일 금통위 앞두고 운용 둔화되어 금리 상승할 전망.

지준 증감 요인

(단위 : 억 원)

2023.01.11(수)				2023.01.12(목)			
국고여유자금		18,000		한국은행RP매각 만기(2일)			20,300
제기금		1,000		국고여유자금			19,000
재정 [국세환급0.3 실시간0.3]		6,000		공자기금			6,000
자금조정예금 만기		36,000		제기금			8,000
				재정 [교육부7.0 행안부1.0 국세환급0.2 실시간0.5]			87,000
				자금조정예금 만기			34,000
				요지준 변동			8,000
공자기금 환수		-1,000		통안채 발행(1년)			-9,800
원천세		-15,000		국고채 발행(2년)			-14,000
화폐		-4,000		원천세			-104,000
자금조정예금		-34,000		화폐			-5,000
				자금조정예금			-40,000
전일 기준	지준	-57,562	적수	823	금일 예상	지준	-48,000
						적수	-48,000

Market Data

(단위 : 조 원)

	레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	콜금리(C2)	기준금리	KOFR	CD(91일)	국고채(3년)	국고채(5년)
2023.01.05(목)	179.9	177.2	2.82%	3.075%		2.925%	3.96%	3.644%	3.607%
2023.01.06(금)	179.5	180.9	2.82%	3.118%		2.929%	3.92%	3.681%	3.624%
2023.01.09(월)	188.3	183.0	2.82%	3.132%	3.25%	2.926%	3.92%	3.577%	3.494%
2023.01.10(화)	179.2	183.8	2.85%	3.166%		3.000%	3.90%	3.556%	3.485%
2023.01.11(수)	179.8		2.85%	3.232%		3.000%	3.88%	3.472%	3.401%

한국은행 공개시장운영 잔액

(단위 : 조 원)

◎ RP매입

입찰일	입찰시간	기일	만기일	응찰금액	금리	낙찰금액	낙찰률	회사번호
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
2023.01.09(월)	11:00~11:10	7	2023.01.16(월)	0.30	3.30%	0.30	100.0%	2023-002-007

◎ 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
2023.01.10(화)	16:00~16:10	2	2023.01.12(목)	2.03	3.25%	2.03	100.0%	2023-003-002

◎ 통화안정계정예치금

입찰일	입찰시간	기일	만기일	예정금액	응찰금액	낙찰금리	낙찰금액	회사번호
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)
공모주	한주라이프메탈	금속 가공제품 제조업	2023.01.10(화) ~ 2023.01.11(수)	2023.01.13(금)	미래(0.82), 현대차(0.53), 유진(0.07)
공모주	TEMCO	반도체 특수가스 제조업	2023.01.10(화) ~ 2023.01.11(수)	2023.01.13(금)	한화(0.02)

관련 정보

지준일	2023.02.08(수)	금통위	2023.01.13(금)	FOMC	2023.01.31(화) ~ 2023.02.01(수)
· 한국은행, 금융통화위원회 의사록(2022년도 제24차) (2023.01.06)					www.bok.or.kr/portal/bbs/P0000559/view.do?nttid=10074820&menuNo=200690
· 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