“국고02375-3112-1002” 발행공고

국채법 제5조에 의하여 “국고02375-3112-1002” 국고채권을 다음과 같이 “국고02375-3112-1000” 발행분(2021.12.10.)과 통합발행 함을 공고합니다.

2021년 11월 10일

기 획 재 정 부 장 관

1. 발 행 일 자 : 2021. 12. 10

2. 상 환 일 자 : 2031. 12. 10

3. 발 행 방 법

(1) 경쟁입찰(국고02375-3112-1002)

ㅇ 입 찰 일 : 2021.11.15.(월) 09:40~10:00
ㅇ 발행예정금액 : 7,000억원
ㅇ 대 금 납 입 일 : 2021.11.16.(화) 15:50까지

(2) 일반인 입찰

ㅇ 참 가 방 식 : 별첨 ‘국고채 발행 세부사항’ 참조
ㅇ 배 정 금 액 : 1,400억원 이내
ㅇ 대금 납입일 : 2021.11.16.(화) 15:50까지

(3) 전문딜러 비경쟁인수(국고02375-3112-1003)

ㅇ 행 사 일 : 2021.11.15.(월) ~ 11.18.(목)
* 2021.11.15.(월) 12:00~15:30, 11.16.(화), 11.17.(수), 11.18.(목) 09:00~15:30
ㅇ 배 정 금 액 : 2,100억원 이내
ㅇ 대금 납입일 : 2021.11.16.(화), 11.17.(수), 11.18.(목), 11.19.(금) 15:50까지
* 대금은 매 행사일의 다음 영업일에 납입함

4. 발행, 상환 및 등록 업무 : 국채법에 따라 한국은행이 담당

※ 기타 자세한 사항은 별첨 ‘국고채 발행 세부사항’을 참조하시기 바랍니다.

<별첨>

국고채 발행 세부사항

1. 다음의 경우에는 국고채 실제 발행액을 조정할 수 있음

ㅇ 경쟁입찰

- 응찰률이 현저히 낮거나 응찰금리가 시장금리수준에 비하여 과도하게 높거나 낮은 경우 발행물량 조정 가능
- 낙찰금리까지 입찰한 물량이 발행예정액을 초과해도 전액 낙찰

・다만, 대규모 입찰 등으로 전액낙찰시 국채발행계획보다 과도하게 많이 발행해야 될 경우에는 일부 조정

ㅇ 일반인 입찰에 응찰이 있을 경우 발행액 조정가능

2. 원금상환 및 이자지급 방법

ㅇ 원금 : 상환일로부터 일시상환

ㅇ 이자 지급방법 : 매6개월 후급
(표면금리로 1년 단위로 계산한 금액의 2분의1 지급)

3. 증 권 발 행 : 등록발행

4. 경쟁입찰 세부 내용

가. 입찰개요

ㅇ 입찰방식 : 한국은행 금융결제망(BOK-Wire+)을 통한 전자입찰방식

* BOK-Wire+를 통한 입찰이 불가능한 금융기관은 모사전송, 전자우편, 서면입찰 방식으로도 응찰가능

ㅇ 입찰일시 : 공고문 참조

ㅇ 입찰예정금액 : 공고문 참조
(일반인 입찰에 의해 우선 배정된 금액을 포함한 금액임)

* 전자입찰에 따른 세부적인 절차는 「국채사무취급절차」 및 「한국은행 금융결제망 전산업무 운영절차」를 준용

나. 입찰방법

ㅇ 입찰참가자격 : 국고채전문딜러 및 예비국고채전문딜러

ㅇ 입찰보증금 : 면 제

ㅇ 입찰금액 : 최저입찰금액은 10억원으로 하고 그 이상은 10억원의 정수배액으로 하며, 1개사당 응찰한도는 경쟁입찰 발행예정금액의 30% 이내로 함(단, 예비국고채전문딜러의 응찰한도는 15%로 함)

ㅇ 입찰신청방법 : 연단위 이자율로 소수점이하 셋째자리까지 명기

- 1개사가 7개까지 복수 응찰금리로 응찰하는 것을 허용
  (단, 동일응찰금리로 재응찰 불가)

- 1개사당 응찰한도를 초과하는 경우 그 초과분은 높은 응찰금리 제시분부터 차감하여 이를 응찰무효로 함

다. 낙찰결정방법

ㅇ 응찰한 금리 중 가장 낮은 금리부터 발행예정액에 달할 때까지 순차적으로 낙찰자를 결정

- 동일한 금리로 응찰한 금액이 발행예정액을 초과해도 전액 낙찰함. 다만, 전액 낙찰시 국고채발행계획보다 과도하게 많이 발행해야 될 경우에는 다음 기준에 따라 배정

① 응찰한 금액에 비례하여 10억원 단위로 배정

② ①의 기준에 의한 배정이후 낙찰자별 잔여금액(10억원 단위 미만 절사분)이 큰 낙찰자부터 10억원 단위로 배정*
(단, 잔여금액이 동일한 경우에는 응찰번호순서대로 배정)

* 10억원 단위로 배정하고, 나머지 10억원미만 금액은 차순위에 배정

ㅇ 낙찰금리

- 낙찰된 국고채의 최고응찰금리

라. 대금납입일 : 공고문 참조

ㅇ 각 낙찰자는 낙찰금리로 납입
(대금은 한국은행에 설치된 당좌예금계정을 통하여 결제)

ㅇ 발행단가의 계산은 1만원 단위 (대금납입은 세전단가로 납입)

< 발행단가 산출식 >

$$\left\{\left(\sum_{t=1}^{n} \frac{10{,}000 \times R/m}{(1+r/m)^{t-1}}\right) + \frac{10{,}000}{(1+r/m)^{n-1}}\right\} \times \frac{1}{(1+r/m \times a/b)}$$

n : 잔존이자지급횟수 m : 연간이자지급횟수
R : 표면금리 r : 낙찰금리
a : 이자지급기중 잔존일수(한편넣기) b : 이자지급기중 일수(한편넣기)
* '십전' 단위 미만은 절사

단, 매출일이 발행일보다 앞서는 경우(선매출시)

$$\left\{\left(\sum_{t=1}^{n} \frac{10{,}000 \times R/m}{(1+r/m)^{t}}\right) + \frac{10{,}000}{(1+r/m)^{n}}\right\} / (1+r/m \times a/b)$$

n : 잔존이자지급횟수 m : 연간이자지급횟수
R : 표면금리 r : 낙찰금리
a : 선매출일수(한편넣기) b : 발행일 직전 6개월 일수(한편넣기)
* 선매출이자단가 = 10,000 - {10,000 / (1+R/m× a/b)}
** '십전' 단위 미만은 절사

5. 비경쟁인수 세부 내용

(1) 일반인 입찰

가. 개 요

ㅇ 참가대상 : 일반인

* 개인과 국채입찰에 참여하지 못하는 금융기관 및 기타 모든 법인 포함

ㅇ 참가방식

- 입찰공고일로부터 입찰 전일까지 입찰대행기관(국고채전문딜러)에 매입희망금액을 기재한 입찰서를 제출하고 입찰보증금 납부

- 입찰대행기관은 입찰에 참여한 일반인의 응찰내역을 입찰일 당일 9시까지 국채사무처리기관(한국은행)에 제출

ㅇ 배정금액 : 공고문 참조 (경쟁입찰 발행예정금액의 20% 이내)

ㅇ 입찰보증금 : 매입희망금액의 100%

ㅇ 응찰금액 : 응찰최저금액은 10만원, 응찰최고금액은 10억원으로 하고, 10만원을 초과하는 금액에 대하여는 10만원 단위로 증액

나. 배정방법

ㅇ 일반인의 총 응찰금액이 일반인 배정금액을 초과하는 경우에는 입찰대행기관의 일반인 응찰총액에 안분비례하여 배정

ㅇ 일반인의 낙찰받은 국채는 입찰대행기관의 명의로 배정하고, 입찰대행기관은 이를 일반인의 고객계좌에 기재함으로써 배정 완료

다. 배정금리

ㅇ 일반인이 배정받는 국채에 적용하는 금리는 경쟁입찰방식에 의해 결정된 최고낙찰금리로 함

라. 대금납입일 : 공고문 참조

(2) 전문딜러 비경쟁인수

가. 개요

○ 참가대상 : 당해 경쟁입찰에서 국고채를 인수한 국고채전문딜러

○ 배정금액 : 공고문 참조 (경쟁입찰 인수금액의 30% 이내)

○ 국고채 전문딜러별 배분 기준 : 당해 경쟁입찰의 국고채 전문딜러별 실적 기준

- 해당기관의 인수실적 × 해당기관의 비경쟁인수 한도율* → 10억원 미만 버림

  * 최근 반기 실적에 따라 우수 PD 그룹 20%, 차상위 그룹 15%, 차차상위 그룹 10%, 기타 PD 5%를 부여하되, (직전월)월별평가 우수 PD 그룹 중 1~5위는 10%p, 6~10위는 5%p 추가 부여

- 각 PD의 비경쟁인수권한 행사금리는 경쟁입찰방식에 의해 결정된 최고낙찰금리로 함

나. 행사 방법

○ 행사일 : 공고문 참조

* 행 사 일 : 경쟁입찰일~경쟁입찰일+3일(영업일 기준)
  행사시간 : 경쟁입찰일 12:00~15:30
  경쟁입찰일+1일~경쟁입찰일+3일 09:00~15:30

○ 최소 옵션단위 : 입찰 최소 단위인 10억원(10억원=옵션 1개)

○ 행사가격(금리) : 경쟁입찰방식에 의해 결정된 최고낙찰금리

다. 대금납입일

* 매 행사일별로 확정된 행사물량에 대한 대금은 행사일 다음 영업일에 납입함

행 사 일	경쟁입찰일(T)	T+1일	T+2일	T+3일
대금납입일	T+1일	T+2일	T+3일	T+4일

6. 기타 상세한 사항은 한국은행 증권팀(02-759-4740,4742)·기획재정부 국채과(044-215-5131/5135)에 문의