

“03200-2607-0206” 통안증권 발행공고

2024년 9월 3일

공개시장운영규정 제14조의2에 의하여 “03200-2607-0206” 통안증권을 다음과 같이 “03200-2607-0200” 발행분(2024.7.2.)과 통합발행 함을 공고합니다.

1. 발행일자: 2024.7.2.
 2. 상환일자: 2026.7.2.
 3. 발행방법: 경쟁입찰(03200-2607-0206)
 - 입찰일시 : 2024.9.4.(수) 10:00~10:10
 - 발행예정금액 : 20,000억원
 - 개별기관 응찰한도 : 12,000억원
 - 대금납입일 : 2024.9.5.(목) 16시까지
- ※ 기타 자세한 사항은 별첨 '통안증권 발행 세부사항'을 참조하시기 바랍니다.

(별첨)

통안증권 발행 세부사항

1. 다음의 경우에는 통안증권 실제 발행액을 조정할 수 있음

- 응찰금액이 발행예정금액의 150% 미만인 경우
- 응찰금리가 시장금리와 과도하게 괴리되는 경우
- 낙찰금리 이하로 응찰한 금액이 발행예정액을 초과하는 경우

2. 원금상환 및 이자지급 방법

- 원금: 상환일에 일시상환(통안증권 원리금 지급일이 공휴일인 경우에는 해당 지급일의 직후 영업일에 당해 지급기분의 원리금을 지급)
- 이자 지급방법: 매 3개월 후급

3. 증권발행: 등록발행

4. 경쟁입찰 세부 내용

가. 입찰개요

- 입찰방식: 한국은행 금융결제망(BOK-Wire+)을 통한 전자입찰방식
- 입찰일시: 공고문 참조
- 입찰예정금액: 공고문 참조

※ 기타 필요한 사항에 관하여는 「공개시장운영규정」, 「공개시장운영세칙」, 「공개시장운영 입찰절차」, 「공개시장운영에 관한 사무취급절차」 및 입찰 공고사항을 준수

나. 입찰방법

- 입찰참가자격: 공개시장운영 대상기관(입찰제한 부진대상기관은 제외)
- 입찰보증금: 면제

- 입찰금액: 최저입찰금액은 100억원으로 하고 그 이상은 100억원의 정수배액으로 하며, 1개사당 응찰한도는 경쟁입찰 발행예정금액의 60% 이내로 함
- 입찰신청방법: 연단위 이자율로 소수점이하 셋째자리까지 명기(0.5bp 단위)
 - 1개사가 6개까지 복수 응찰금리로 응찰 가능
(단, 동일 응찰금리로 재응찰 불가)

다. 낙찰결정방법

- 응찰한 금리 중 가장 낮은 금리부터 발행예정액에 달할 때까지 순차적으로 낙찰자를 결정
 - 동일한 금리로 응찰한 금액이 발행예정액을 초과할 경우 필요시 발행예정금액의 20%범위 이내에서 초과 낙찰할 수 있음
- 낙찰금리
 - 경쟁입찰방식에 의해 결정된 최고낙찰금리(단일금리방식)

라. 대금납입일: 공고문 참조

- 각 낙찰자는 낙찰금리로 납입(한국은행에 설치된 당좌예금계정을 통하여 결제)
- 발행가액의 계산은 백만원 단위(원미만 끝수는 버림)

<발행가액 산출식>

$$\text{발행가액} = \left[\sum_{t=1}^n \frac{\text{액면금액} \times \frac{R}{m}}{\left(1 + \frac{r}{m}\right)^{t-1}} + \frac{\text{액면금액}}{\left(1 + \frac{r}{m}\right)^{n-1}} \right] \times \frac{1}{\left(1 + \frac{r}{m}\right)^{\frac{d}{D}}}$$

다만, R : 표면금리, r : 발행수익률

m : 연간 이자지급 횟수, n : 남은 이자지급 횟수

d : 매출일 다음날부터 다음 이자지급기일까지의 일수

D : 직전 이자지급기일(이자지급이 없는 경우 발행일) 다음날부터 다음 이자지급기일까지의 일수