

10월 국고채 8.5조원 경쟁입찰 발행 계획

기획재정부는 10월 85,000억원 수준의 국고채를 전문딜러(PD) 등이 참여하는 경쟁입찰 방식으로 발행한다.

이는 지난달 경쟁입찰 발행계획(110,000억원)에 비해 25,000억원 감소한 금액이다. 연물별로는 2년물 10,000억원, 3년물 15,000억원, 5년물 14,000억원, 10년물 15,000억원, 20년물 4,000억원, 30년물 23,000억원, 50년물 3,000억원, 물가채 1,000억원을 경쟁입찰 발행한다.

아울러 전문딜러(PD)와 일반인은 각 연물별 경쟁입찰 당시의 낙찰금리로 일정 금액을 비경쟁 인수할 수 있다.

이와 함께 기획재정부는 국고채 유동성 제고를 위해 10년물, 20년물 경과종목과 30년물 지표종목 간 3,000억원 수준의 교환을 실시할 계획이다. 또한 만기도래 전 국고채 매입을 총 30,000억원 수준으로 1차례 실시할 예정이다.

한편, 경쟁입찰 발행, 비경쟁인수, 교환을 모두 포함한 9월 실제 발행 규모는 132,090억원으로 예상된다. 이에 따라 1~9월 국고채 발행 규모는 누적 1,443,573억원으로 예상된다. 다만, 최종 발행실적은 9.22(금) 발표되는 20년물 비경쟁인수 결과에 따라 변경될 수 있다.

담당 부서	국고국 국채과	책임자	과 장	조성중 (044-215-5130)
		담당자	사무관	이상아 (s3253a@korea.kr)
			주무관	홍단기 (hdk0711@korea.kr)

별첨1

2023년 10월 국고채 경쟁입찰 발행 계획

- '23년 10월 85,000억원 수준의 국고채 경쟁입찰 발행
- 10월 12일(목) 매출되는 국고채 2년물 10,000억원은 “국고03625-2509”으로 통합 발행
 - 10월 12일(목) 매출되는 국고채 3년물 15,000억원 중 9,000억원은 “국고03125-2606”으로 통합 발행하고, 6,000억원은 “국고00000-2612”으로 신규 발행(선매출)
 - 10월 24일(화) 매출되는 국고채 5년물 14,000억원은 “국고03500-2809”으로 통합 발행
 - 10월 17일(화) 매출되는 국고채 10년물 15,000억원 중 9,000억원은 “국고03250-3306”으로 통합 발행하고, 6,000억원은 “국고00000-3312”으로 신규 발행(선매출)
 - 10월 10일(화) 매출되는 물가연동국고채 1,000억원은 “물가01625-3206”으로 통합 발행
 - 10월 25일(수) 매출되는 국고채 20년물 4,000억원은 “국고03875-4309”으로 통합 발행
 - 10월 5일(목) 매출되는 국고채 30년물 23,000억원은 “국고03625-5309”으로 통합 발행
 - 10월 16일(월) 매출되는 국고채 50년물 3,000억원은 “국고03500-7209”으로 통합 발행

'23년 10월 국고채권 발행일정(단위: 억원)

구 분		입찰 공고일	입찰일	대금 납입일	발행일	통합발행기간*	발행 예정액
2년물	국고03625-2509(23-8)	10.5.(목)	10.11.(수)	10.12.(목)	'23.09.10.	발행일부터 6개월	10,000
3년물	국고03125-2606(23-4)	10.4.(수)	10.10.(화)	10.12.(목)	'23.06.10.	발행일부터 6개월	9,000
	국고00000-2612(23-10)	10.4.(수)	10.10.(화)	10.12.(목)	'23.12.10.	발행일부터 6개월	6,000
5년물	국고03500-2809(23-6)	10.18.(수)	10.23.(월)	10.24.(화)	'23.09.10.	발행일부터 6개월	14,000
10년물	국고03250-3306(23-5)	10.11.(수)	10.16.(월)	10.17.(화)	'23.06.10.	발행일부터 6개월	9,000
	국고00000-3312(23-11)	10.11.(수)	10.16.(월)	10.17.(화)	'23.12.10.	발행일부터 6개월	6,000
물가채	물가01625-3206(22-6)	9.27.(수)	10.6.(금)	10.10.(화)	'22.06.10.	발행일부터 2년	1,000
20년물	국고03875-4309(23-9)	10.19.(목)	10.24.(화)	10.25.(수)	'23.09.10.	발행일부터 1년	4,000
30년물	국고03625-5309(23-7)	9.25.(월)	10.4.(수)	10.5.(목)	'23.09.10.	발행일부터 6개월	23,000
50년물	국고03500-7209(22-12)	10.10.(화)	10.13.(금)	10.16.(월)	'22.09.10.	발행일부터 2년	3,000
교환	명목채	10.12.(목)	10.17.(화)	10.19.(목)	'23.09.10.	발행일부터 6개월	3,000

* 통합발행제도 : 표면금리·만기 등이 같아 동일 종목으로 취급되는 국고채권을 일정기간(2년·3년·5년·10년·30년물-6개월, 20년물-1년, 물가채·50년물-2년) 동안 통합하여 발행하는 제도

별첨2

2023년 10월 국고채 비경쟁인수 발행 계획

□ 전문딜러(PD) 및 일반인은 비경쟁인수 방식으로 각 연물별로 경쟁입찰 당시의 낙찰금리로 일정 금액을 인수 가능

① (일반인 우선배정) 일반인이 입찰 전일까지 전문딜러를 통해 응찰서 제출 시, 경쟁입찰 발행예정금액의 20%(총 16,400억원) 범위 내에서 우선 배정(50년물 제외)

② (전문딜러 비경쟁인수) 각 전문딜러는 낙찰일 이후 3영업일 이내에 경쟁입찰 낙찰금액의 10~35%* 범위에서 추가 인수 가능

* 반기평가 우수PD 25%p, 차상위 20%p, 차차상위 15%p, 기타 10%p 부여 + 월평가 우수 PD 그룹에 5~10%p 추가

③ (스트립 조건부 비경쟁인수) 각 스트립 전문딜러는 낙찰일 이후 3영업일에 3·5년물 2,210억원, 10·30년물 2,710억원, 20년물 1,700억원 범위에서 최대 200억원까지 인수* 가능

* 스트립 조건부 비경쟁인수 권한을 행사한 스트립 전문딜러는 월간 계획을 기준으로 배정일이 속한 월의 익월 중 원금과 이자를 분리(스트립)해야 함

※ (참고) 10월 모집 방식 비경쟁인수 실시 여부와 세부 계획은 10월 19일(목) 별도로 공지할 계획

별첨3**2023년 10월 국고채 매입 계획**

☐ 총 30,000억원 규모 국고채 매입 계획

국고채 매입 세부종목 및 규모

일 시	매입대상 종목	규 모
10.18.(수) 10:40 ~ 11:00	<ul style="list-style-type: none"> ■ 국고03500-2403(14-2) ■ 국고01875-2412(21-10) ■ 국고01500-2503(20-1) ■ 국고02250-2506(15-2) ■ 국고01125-2509(20-6) ■ 국고02250-2512(15-8) <p>* 구체적인 내용은 공고문(10월 13일, 한국은행 홈페이지)을 통해 추후 발표</p>	30,000억원

별첨4**2023년 10월 국고채 교환 계획**

☐ 국고채 유동성 제고를 위해 10년물, 20년물 경과 종목과 30년물 지표 종목 간 3,000억원 수준의 교환을 실시할 계획

국고채 교환 세부종목 및 규모

일 시	발행대상 종목	매입대상 종목	규 모
10.17.(화) 10:40 ~ 11:00	국고03625-5309 (2053. 9. 10. 만기, 30년물)	<ul style="list-style-type: none"> ■ 국고01375-3006(20-4) ■ 국고01500-3012(20-9) ■ 국고02000-3106(21-5) ■ 국고02625-3509(15-6) ■ 국고01500-4009(20-7) ■ 국고01875-4109(21-9) <p>* 구체적인 내용은 공고문(10월 12일, 한국은행 홈페이지)을 통해 추후 발표</p>	3,000억원

별첨5

2023년 9월 국고채 발행 실적

□ 2023년 9월 국고채 발행규모는 132,090.0억원^e

* 명목채 131,090.0억원^e, 물가채 1,000억원 발행

명목국고채

(단위 : 억원)

구분	경쟁입찰			비경쟁 인수(I) (B)	비경쟁 인수(II) (C)	스트립 조건부 비경쟁 인수(III) (D)	모집 방식 비경쟁 인수(IV) (E)	국고채 교환 (F)	합계 (A+B+C+D+E+F)
	입찰일	발행 계획	발행규모 (가평낙찰 금리,%) (A)						
명목2년물 (국고03625-2509)	'23.9.5.	14,000	14,000 3.800	-	-	-	-	-	14,000.0
명목3년물 (국고03125-2606)	'23.9.4.	21,000	21,000 3.710	-	-	-	-	-	21,000.0
명목5년물 (국고03500-2809)	'23.9.18.	18,000	17,970 3.925	-	-	-	-	-	17,970.0
명목10년물 (국고03250-3306)	'23.9.11.	19,000	19,020 3.955	-	5,380	2,710	-	-	27,110.0
명목20년물 (국고03875-4309)	'23.9.19.	5,000	5,000 3.830	-	-*	-*	-	-	5,000.0
명목30년물 (국고03625-5309)	'23.8.28.	29,000	29,000 3.805	0.49	8,290	2,710	-	2,000	42,000.0
명목50년물 (국고03500-7209)	'23.9.8.	4,000	4,010 3.730	-	-	-	-	-	4,010.0
합계		110,000	110,000	0.49	13,670	5,420	-	2,000	131,090.0

* 9.22(금) 20년물 비경쟁인수(II,III) 금액 확정 예정

물가연동국고채

(단위 : 억원)

구분	경쟁입찰				교 환 (B)	합 계 (A+B)
	입찰일	발행계획	가평낙찰 금리(%)	발행규모(A)		
물가10년물 (물가01625-3206)	-	-	-	-	1,000	1,000