

KHFC MBS 2016-16 입찰공고

우리 공사의 「KHFC MBS 2016-16」 발행을 위한 공개입찰을 다음과 같이 시행하니, 인수할 수 있는 금융회사는 응찰하여 주시기 바랍니다.

2016년 8월 2일

한국주택금융공사 사장

1. 발행개요

- 종목명 : KHFC MBS 2016-16
- 발행일자 : '16.8.5.(금)
- 발행금액 : 선순위 약 17,874억원, 후순위 미정
- 원금상환방법 : “별첨” 참조
- 이자지급방법 : 매3개월 후급

2. 입찰방법

- 입찰방식 : 연합인포맥스 채권입찰시스템을 활용한 전자입찰
- 입찰대상 : 선순위증권 17,800억원
- '16.8.3.(수) 오전 09:30 ~ 11:15
- 인수방식 : 공사와 총액인수매출계약을 체결한 주관사단이 납입일에 납입을 완료한 판매사(낙찰회사)에 낙찰물량을 배정

KHFC MBS 2016-16 발행 세부사항

1. 대상채권 : KHFC MBS 2016-16

발행자	한국주택금융공사 신탁(수탁자 : 한국주택금융공사)					
발행증권	주택저당증권					
발행금액	선순위 : 17,874억원 후순위 : 미정					
발행일자	'16.8.5.(금)					
발행구조	(단위 : 억원)					
	구분	만기	금액	금리	이자지급	콜옵션 ^{주1)}
	선순위	1년	2,074	1년 국고채+가산금리	매3개월 후급	-
		2년	3,600	2년 국고채+가산금리		-
		3년	2,900	3년 국고채+가산금리		-
		5년	6,600	5년 국고채+가산금리		3개월 이후
		7년	1,400	"		2년 이후
		10년	900	10년 국고채+가산금리		3년 이후
		15년	300	"		4년 이후
		20년	100	"		5년 이후 ^{주2)}
	후순위	21년	미정	미정	만기일시 연단리	-
주1) 매3개월, 1% 배수 단위						
주2) 7년~20년 만기 종목의 콜옵션은 직전만기 종목의 상환 완료일로부터 행사 가능						
* 종목별 발행금액은 시장상황에 따라 변경될 수 있음						
○ 선순위 : KHFC 지급보증, AAA(NICE신용평가)* 신용등급, 상장, 공모						
○ 후순위 : 사모 (한국주택금융공사 보유 예정)						
발행금리	(선순위) 국고채 기준금리+낙찰 가산금리, (후순위) 미정					
대상자산	주택담보대출 약 17,503억원					

* 2010년부터 1개 신용등급 취득

2. 입찰 내용

☐ 입찰일자 : '16.8.3.(수)

☐ 입찰방식 : 연합인포맥스 채권입찰시스템을 통한 가산금리 전자입찰

☐ 참가대상 : 연합인포맥스 채권입찰시스템 전자입찰 등록 금융회사

□ 낙찰 가산금리, 금액 및 금리결정 방식

○ 단일금리결정방식(Dutch 방식) 적용

- 가장 낮은 스프레드를 제시한 물량부터 합산하여 매각예정액에 달할 때까지 순차적으로 낙찰을 진행
- 낙찰된 물량* 중 가장 높게 제시한 스프레드**를 최종 “낙찰 스프레드”로 결정하여 단일금리로 적용

* 동일한 스프레드로 응찰하여 발행 예정액을 초과시 응찰 시간순으로 낙찰하고, 최종 낙찰자의 입찰금액이 발행예정액을 초과할 경우 분할하여 낙찰 가능

** 단, 낙찰 스프레드가 주관사단 제안 스프레드보다 높거나 잔여물량이 발생한 경우에는 주관사단 제안 스프레드를 낙찰 스프레드로 결정

○ 대상채권 국고채금리에 낙찰 스프레드를 더하여 발행금리를 확정

○ 인포맥스옥션 입찰방식 (호가완전공개 입찰라운드연장방식)

경매구성	비공개입찰	공개입찰	
라운드구성	0라운드	1라운드	2라운드 (종료)
진행시간	10분	3분	2분
참여방식	제한없음	제안스프레드 이하, 낙찰범위내 입찰	
취소/변경	취소/변경 가능	취소/변경 불가능	
입찰자격	채권경매시스템 등록기관 (0라운드참여지만 1 라운드참여가능)	0라운드 낙찰순위로 경매수량 2배수이내 입찰자	1라운드 낙찰순위로 경매수량 1.5배수이내 입찰자
입찰가능 수량	입찰수량 제한없음	0라운드 낙찰순위로 경매수량 2배수이내 입찰한 수량 이하	1라운드까지 낙찰순위로 경매수량 1.5배수이내 입찰한 수량 이하
종료방법	공개입찰 (1라운드)로 의무 진행	현라운드 새로운 호가로 낙찰범위 내 입찰이 밀려나면 2라운드 진행 (변경 없을 시 경매 종료)	2라운드를 최종으로 경매 종료

□ 낙찰결과 발표 : 입찰 종료후 연합인포맥스 채권입찰시스템을 통해 발표

☐ 납입일 : '16.8.5.(금)

☐ 인수방식

- 공사와 총액인수매출계약을 체결한 주관사단이 납입일에 납입을 완료한 판매사(낙찰회사)에 낙찰물량 배정

※ 주관사단 : 삼성증권(주), 동부증권(주), 하나금융투자(주), 메리츠종합금융증권(주), 에이치엠씨투자증권(주), 한국투자증권(주), 한화투자증권(주), 미래에셋대우(주)

☐ 판매사(낙찰회사) 수수료 : 낙찰금액의 0.013%

- 낙찰회사는 총액인수 주관사단을 통하여 판매수수료를 수취

3. 입찰일시 및 입찰대상종목

일 시		입찰대상종목
'16.8.3.(수)	09:30(입찰시작)~ 09:45분(입찰마감)	1년, 15년
	10:00(입찰시작)~ 10:15분(입찰마감)	3년, 10년
	10:30(입찰시작)~ 10:45분(입찰마감)	2년, 7년
	11:00(입찰시작)~ 11:15분(입찰마감)	5년, 20년

4. 응찰방식

☐ 응찰내용 : 인수희망 가산금리(국고채 대비, bp) 수준과 금액

- 최저 입찰규모는 100억원이며 입찰금액 단위는 50억원임

※ 발행금리 : 발행일 2영업일 전 3영업일 (8/1, 8/2, 8/3일자) 한국금융투자협회 국고채 시가평가기준수익률 평균(소수점 넷째자리 이하 절사) + 낙찰 가산금리

5. 기타

☐ 입찰 참가를 위해 연합인포맥스 채권입찰시스템 및 인증 장치를 설치한 후 응찰자 신청 및 등록

☐ 전자입찰시스템 관련 문의: 연합인포맥스 채권입찰시스템(02-398-5211)

기타 입찰관련 문의: 한국주택금융공사 유동화증권부(02-2014-7673)