

신규상장 주가지수 · 주식 선물 및 주식옵션 관련 증거금 파라미터 안내

(한국거래소 청산결제본부 장내리스크관리팀)

- (안내사항) 파생상품시장 신규상품의 증거금률은 기초자산 가격 변동성을 기초로 상품별 특성 등을 감안하여 아래와 같이 결정
 - 코리아밸류업지수를 제외한 신규 기초자산의 감면액 산출 변수는 잠재상품군 및 미결제약정 규모를 고려해 추후 반영

□ (증거금률) 총 46개 기초자산

- 주가지수선물 1종목, 주식선물 39종목 주식옵션 6종목

※ 산출기준일 : '24.10.24

구분	기초자산	거래 증거금률(%)	위탁 증거금률(%)	유지위탁증거금률(%)
지수선물	코리아밸류업 선물	8.700	13.050	8.700
유가선물	DL 선물	13.500	20.250	13.500
	KG스틸 선물	23.300	34.950	23.300
	TCC스틸 선물	33.500	50.250	33.500
	TKG휴켄스 선물	10.700	16.050	10.700
	녹십자홀딩스 선물	15.200	22.800	15.200
	대웅 선물	21.700	32.550	21.700
	더블유게임즈 선물	12.800	19.200	12.800
	동원시스템즈 선물	19.000	28.500	19.000
	두산로보틱스 선물	25.200	37.800	25.200
	롯데관광개발 선물	16.700	25.050	16.700
	롯데웰푸드 선물	14.700	22.050	14.700
	명신산업 선물	20.400	30.600	20.400
	삼양식품 선물	17.400	26.100	17.400
	세방전지 선물	17.500	26.250	17.500
	세아베스틸지주 선물	14.200	21.300	14.200
	세아제강지주 선물	14.400	21.600	14.400
	영원무역홀딩스 선물	10.200	15.300	10.200
	영풍 선물	66.600	99.900	66.600
	오리온홀딩스 선물	10.000	15.000	10.000

	울촌화학 선물	21.000	31.500	21.000
	이수스페셜티케미컬 선물	39.800	59.700	39.800
	일진하이솔루스 선물	13.800	20.700	13.800
	코스모신소재 선물	23.600	35.400	23.600
	풍산 선물	19.500	29.250	19.500
	한국엔컴퍼니 선물	12.400	18.600	12.400
	한미반도체 선물	19.700	29.550	19.700
	한일시멘트 선물	13.500	20.250	13.500
코스닥선물	HPSP 선물	23.000	34.500	23.000
	SOOP 선물	17.300	25.950	17.300
	더블유씨피 선물	19.200	28.800	19.200
	동국제약 선물	12.500	18.750	12.500
	두산테스나 선물	17.300	25.950	17.300
	솔브레인홀딩스 선물	21.500	32.250	21.500
	심텍 선물	16.500	24.750	16.500
	아이티엠반도체 선물	17.000	25.500	17.000
	에코프로에이치엔 선물	30.100	45.150	30.100
	코미코 선물	16.000	24.000	16.000
	포스코엠텍 선물	21.400	32.100	21.400
	휴온스 선물	13.600	20.400	13.600
	유가 옵션*	HD현대일렉트릭 옵션	28.400	42.600
LS ELECTRIC 옵션		20.500	30.750	20.500
삼성바이오로직스 옵션		14.000	21.000	14.000
삼성생명 옵션		11.800	17.700	11.800
하이브 옵션		16.700	25.050	16.700
코스닥옵션*	알테오젠 옵션	23.600	35.400	23.600

* 주식옵션 상품은 해당 기초자산의 11월 주식선물상품 증거금률과 동일

(증거금 감면액 산출변수) 코리아밸류업지수 상대적 규모비율
신규 산정 외 주가지수 상품군의 감면액 산출변수 변경 없음

【 주가지수상품군 증거금 감면액 산출변수 】

기초자산	상품군	상대적규모비율	가격상관율
코리아밸류업 지수	주가지수상품군	9.5	55%

(시행일) 2024. 11. 4(월)