

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

○ 코스닥글로벌지수를 제외한 신규 기초자산의 감면액 산출 변수는 잠재상품군 및 미결제약정 규모를 고려해 추후 반영

□ (증거금률) 총 43개 기초자산

○ 주가지수선물 1종목, 주식선물 37종목 주식옵션 5종목

※ 측정 기준시점: '24.04.11

구분	기초자산	거래 증거금률(%)	위탁 증거금률(%)	유지위탁증거금률(%)
지수선물	코스닥글로벌지수	9.800	14.700	9.800
유가 선물	OCI홀딩스	16.500	24.750	16.500
	HD현대일렉트릭	26.800	40.200	26.800
	JB금융지주	12.800	19.200	12.800
	KG모빌리티	16.800	25.200	16.800
	LS ELECTRIC	23.900	35.850	23.900
	SK케미칼	17.000	25.500	17.000
	금양	25.700	38.550	25.700
	금호타이어	16.300	24.450	16.300
	녹십자	14.100	21.150	14.100
	대웅제약	17.100	25.650	17.100
	덴티움	17.400	26.100	17.400
	두산	33.100	49.650	33.100
	롯데정밀화학	11.700	17.550	11.700
	롯데칠성음료	10.200	15.300	10.200
	삼아알미늄	20.000	30.000	20.000
	에스엘	14.100	21.150	14.100
	에코프로머티	47.500	71.250	47.500
	오뚜기	9.600	14.400	9.600

코스닥 선물	종근당	15.100	22.650	15.100
	코스모화학	21.100	31.650	21.100
	코오롱인더스트리	12.500	18.750	12.500
	키움증권	14.400	21.600	14.400
	효성	11.200	16.800	11.200
	효성첨단소재	16.000	24.000	16.000
	효성티앤씨	15.500	23.250	15.500
	힐라홀딩스	13.100	19.650	13.100
	골프존	12.900	19.350	12.900
	넥스틴	16.400	24.600	16.400
	메가스터디교육	13.100	19.650	13.100
	원익QnC	15.800	23.700	15.800
	유진테크	22.400	33.600	22.400
유가 옵션*	이녹스첨단소재	15.500	23.250	15.500
	주성엔지니어링	19.000	28.500	19.000
	파마리서치	14.800	22.200	14.800
	피에스케이	17.700	26.550	17.700
코스닥 옵션*	하나머티리얼즈	17.800	26.700	17.800
	하림지주	13.600	20.400	13.600
	포스코인터내셔널	15.100	22.650	15.100
	포스코DX	17.900	26.850	17.900
	한화에어로스페이스	23.400	35.100	23.400
	엘앤에프	21.100	31.650	21.100
	에코프로비엠	22.000	33.000	22.000

* 주식옵션 상품은 해당 기초자산의 4월 기준 주식선물상품 증거금률 적용

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

【주가지수상품군 증거금 감면액 산출변수】

기초자산	상품군	상대적규모비율	가격상관율
코스닥글로벌지수	주가지수상품군	7.2	60%

□ (시행일) 2024. 4. 22(월)