

'24년 7월 장내 파생상품시장 증거금 감면액 산출변수 변경결과

(청산결제본부 CCP리스크관리부 장내리스크관리팀)

- **(개요)** 「증권·파생상품시장 증거금 관리지침」 제20조(증거금 감면액 산출 변수의 변경)에 따라 장내 파생상품시장 증거금 감면액 산출변수 점검

※ 증거금 감면액 산출변수(상품군, 가격상관율, 상대적 규모비율)를 연 2회 점검하고 필요시 변경

□ **(변경결과)**

- **(상품군 구성)** 상품군 목록은 현행 23개를 유지하고, 기초자산의 개수는 현행 175개에서 28개를 편입한 203개 기초자산 선정
- **(가격상관율)** 17개 상품군에서 변경, 6개 상품군은 유지
- **(상대적 규모비율)** 164개 기초자산의 상대적 규모비율 변경

※ 세부 변경내역은 붙임참조

□ **(시행일)** 2024. 7. 29(월)

- 시행일의 직전 거래일("24.7.26(금)) 정규거래시간 종료 후에는 변경된 산출변수에 따라 거래증거금, 위탁증거금 및 추가위탁 증거금 산출

상품군	기초자산	현행		변경안	
		상대적 규모비율	가격 상관율	상대적 규모비율	가격 상관율
국채상품군	30년국채	1.0	40%	(제외)	65%
	10년국채	1.2		1.0	
	3년국채	1.3		1.1	
	5년국채	1.3		1.1	
통화상품군	위안	1.0	45%	1	70%
	유로	1.3		1.3	
	미국달러	1.4		1.4	
	엔	2.0		(제외)	
주가지수상품군	코스피200	1.0	60%	1.0	55%
	KRX300	1.1		1.1	
	코스닥글로벌	7.2		6.5	
	코스닥150	6.8		6.6	
	배당성장50	12.5		12.5	
	고배당50	15.1		15.3	
	ARIRANG 고배당주	74.2		74.3	
	KODEX 삼성그룹	94.2		94.0	
금융(지주)	금융지수	1.0	70%	1.0	70%
	KB금융	12.0		12.0	
	하나금융지주	14.8		14.8	
	메리츠금융지주	(신규)		15.0	
	신한지주	17.0		17.2	
	우리금융지주	49.9		52.0	
	기업은행	60.3		60.4	
	JB금융지주	(신규)		71.8	
	DGB금융지	79.6		80.4	
	BNK금융지	88.7		89.9	
금융(증권)	키움증권	(신규)	65%	1.0	70%
	한국금융지주	1.0		1.5	
	삼성증권	1.8		2.6	
	NH투자증권	6.6		9.3	
	미래에셋증권	9.0		13.4	
전자제조업종	정보기술	1.0	50%	1.0	45%
	삼성SDI	5.2		5.4	
	LG이노텍	12.2		11.7	
	천보	15.0		(제외)	
	리노공업	(신규)		18.5	
	삼성전기	21.0		21.5	

상품군	기초자산	현행		변경안	
		상대적 규모비율	가격 상관율	상대적 규모비율	가격 상관율
전자제조업종	이오테크닉스	31.9	50%	27.2	45%
	티씨케이	26.3		27.7	
	SK하이닉스	30.3		27.7	
	LG전자	27.8		29.5	
	삼성전자	47.5		46.9	
	롯데에너지머티리얼즈	46.5		48.1	
	DB하이텍	58.9		58.6	
	하나머티리얼즈	(신규)		68.0	
	덕산네오룩스	75.2		73.5	
	유진테크	(신규)		86.4	
	이녹스첨단소재	(신규)		88.1	
	원익IPS	(신규)		93.9	
	피에스케이	(신규)		152.0	
	고영	187.6		197.6	
	LG디스플레이	187.4		222.1	
	서울반도체	238.2		267.9	
	파트론	344.6		355.4	
SFA반도체	554.6	564.0			
기계전기항공업종군	중공업	1.0	40%	1.0	40%
	한화에어로스페이스	3.0		2.7	
	HD현대중공업	(신규)		2.7	
	LIG넥스원	(신규)		3.1	
	HD한국조선해양	3.3		3.2	
	HD현대일렉트릭	(신규)		3.8	
	HD현대미포	3.9		4.0	
	피엔티	5.7		6.3	
	한국항공우주	6.3		6.4	
	두산밥캣	6.7		7.1	
	현대엘리베이	8.4		8.8	
	현대로템	10.7		10.8	
	한화오션	12.0		13.0	
	두산에너지빌리티	19.0		19.1	
	한화시스템	23.3		22.1	
	HD현대인프라코어	(신규)		39.4	
삼성중공업	47.6	46.5			
운수장비 및운송업종군	산업재	1.0	50%	1.0	55%
	현대모비스	2.6		2.7	
	현대차	3.2		3.2	
	현대글로벌비스	3.5		3.5	

상품군	기초자산	현행		변경안	
		상대적 규모비율	가격 상관율	상대적 규모비율	가격 상관율
운수장비 및운송업종군	CJ대한통운	5.1	50%	5.6	55%
	기아	7.9		7.4	
	현대위아	9.1		9.7	
	한진칼	11.8		11.7	
	HL만도	11.8		13.1	
	대한항공	23.8		24.7	
	HMM	25.1		27.1	
	한온시스템	(신규)		63.9	
	금호타이어	(신규)		134.2	
	팬오션	107.50		(제외)	
철강금속업종군	철강소재	1.0	70%	1.0	70%
	POSCO 홀딩스	2.7		2.5	
	현대제철	22.3		23.7	
화학(재료)업종군	에너지화학	1.0	30%	1.0	50%
	LG화학	2.4		2.7	
	2차전지 TOP 10	2.5		2.9	
	LG에너지솔루션	2.9		3.4	
	효성첨단소재	(신규)		3.6	
	효성티앤씨	(신규)		3.8	
	포스코퓨처엠	4.8		6.9	
	한솔케미칼	7.6		7.2	
	엘앤에프	(신규)		8.1	
	SK이노베이션	9.1		9.0	
	에코프로비엠	6.6		9.3	
	롯데케미칼	9.3		9.3	
	대한유화	(신규)		10.1	
	금호석유	(신규)		10.9	
	SKC	15.8		13.2	
	SK아이이테크놀로지	19.6		15.8	
	SK케미칼	(신규)		16.2	
	LS ELECTRIC	(신규)		22.3	
	롯데정밀화학	(신규)		25.0	
	씨에스윈드	22.0		25.3	
	코오롱인더	(신규)		29.7	
	금양	(신규)		33.5	
	한화솔루션	34.0		36.2	
PI첨단소재	47.3	43.7			
동진세미캠	43.8	45.1			
두산퓨얼셀	53.3	49.0			

상품군	기초자산	현행		변경안	
		상대적 규모비율	가격 상관율	상대적 규모비율	가격 상관율
화학(재료)업종군	한화	55.8	30%	56.6	50%
	대한전선	107.1		108.7	
	후성	121.2		113.8	
건설건축업종	건설	1.0	50%	1.0	55%
	KCC	1.1		1.1	
	한전기술	4.2		(제외)	
	DL이앤씨	6.8		6.6	
	현대건설	7.2		7.3	
	GS건설	10.7		11.1	
	삼성E&A	11.0		11.6	
	대우건설	57.6		58.8	
서비스(오락,문화)업종군	하나투어	1.0	30%	1.0	60%
	강원랜드	2.9		2.9	
	파라다이스	3.4		4.0	
	GKL	3.1		4.0	
금융(보험)업종군	삼성화재	1.0	45%	1.0	50%
	DB손해보험	3.0		3.1	
	삼성생명	3.3		3.6	
	현대해상	(신규)		8.9	
	한화생명	88.2		99.8	
서비스(방송,연예)업종군	하이브	1.0	40%	1.0	50%
	에스엠	2.1		2.2	
	JYP Ent	2.3		2.5	
	와이지엔터	3.5		3.7	
서비스(IT)업종군	엔씨소프트	1.0	40%	1.0	50%
	NAVER	1.7		1.6	
	크래프톤	1.7		1.6	
	BBIG	1.9		1.8	
	삼성SDS	3.0		2.8	
	컴투스	5.0		5.2	
	카카오	5.8		5.4	
	넷마블	5.8		5.4	
	카카오페이	5.2		5.6	
	위메이드	6.1		6.1	
	풀어비스	6.5		6.7	
	카카오게임즈	8.2		8.3	
	포스코DX	26.4		19.7	
	웹젠	21.9		21.0	
NHN KCP	26.6	24.0			

상품군	기초자산	현행		변경안	
		상대적 규모비율	가격 상관율	상대적 규모비율	가격 상관율
화학(화장품)업종군	생활소비재	1.0	55%	1.0	40%
	LG생활건강	1.0		2.1	
	아모레퍼시픽	5.9		6.0	
	코스맥스	10.2		6.3	
	한국콜마	21.3		15.6	
	아모레G	22.0		27.3	
유통(복합소매) 업종군	신세계	1.0	55%	1.0	50%
	BGF리테일	(신규)		1.3	
	이마트	1.9		2.0	
	롯데쇼핑	2.5		2.5	
	호텔신라	2.9		2.9	
	현대백화점	3.4		3.4	
	GS리테일	8.0		8.1	
	동서	9.2		9.5	
의약품업종군	헬스케어	1.0	55%	1.0	55%
	삼성바이오로직스	2.6		2.3	
	TIGER 헬스케어	6.1		6.1	
	한미약품	7.1		6.6	
	바이오 TOP 10	8.8		9.1	
	셀트리온	10.5		10.7	
	메디톡스	12.7		11.5	
	녹십자	(신규)		11.6	
	휴젤	13.9		12.8	
	SK바이오사이언스	15.9		16.4	
	종근당	(신규)		20.6	
	에스티팜	22.4		21.4	
	SK바이오팜	22.3		22.3	
	알테오젠	37.3		27.0	
	삼천당제약	39.8		32.3	
	유한양행	35.7		32.7	
	리가켄바이오	45.7		40.9	
	한미사이언스	43.4		45.0	
	HK이노엔	49.4		45.7	
	씨젠	43.9		52.6	
에스디바이오센서	60.1	(제외)			
콜마비엔에이치	64.1	74.3			
한올바이오파마	96.7	82.2			
서비스(통신)업종군	SK텔레콤	1.0	60%	1.0	65%
	KT	1.6		1.4	
	LG유플러스	4.1		(제외)	

상품군	기초자산	현행		변경안	
		상대적 규모비율	가격 상관율	상대적 규모비율	가격 상관율
내구소비재업종군	경기소비재	(신규)	55%	1.0	55%
	코웨이	1.0		26.4	
	한세실업	3.2		79.3	
음식료담배업종군	오뚜기	(신규)	50%	1.0	45%
	농심	(신규)		1.1	
	CJ제일제당	(신규)		1.3	
	롯데칠성	(신규)		2.9	
	오리온	(신규)		3.8	
	케이티앤지	1.0		4.8	
	하이트진로	3.9		18.2	
	대상	4.5		20.8	
무역업종군	포스코인터내셔널	1.1	75%	1.0	70%
	LX인터내셔널	1.0		1.1	
전력가스업종군	한전KPS	1.0	60%	1.0	65%
	한국가스	1.1		1.1	
	한국전력	1.7		1.8	