

파생상품시장 업무규정 시행세칙 일부개정세칙안

신·구조문대비표

현행	개정안
<p>제81조(시장조성 상품·종목·기간)</p> <p>① (생략)</p> <p>② 규정 제83조제4항에 따라 시장조성호가를 제출할 수 있는 종목은 <u>시장조성상품의 모든 종목으로 한다.</u> 다만, 거래소가 시장조성호가를 의무적으로 제출하도록 정한 종목(이하 “시장조성 의무종목”이라 한다)에 대해서는 거래소가 정하는 바에 따라 시장조성호가를 제출하여야 한다.</p> <p>③~④ (생략)</p> <p>[별표 1] 시장조성자 선정 기준 기초자산기준가격 (제2조제1호 관련)</p> <p>(이하 중간 생략)</p> <p>비고 1. 제13호 및 제14호에서 “거래소가 지정하는 국제적인 정보통신서비스제공자”란 <u>로이터(Reuters)</u>를 말한다. 다만, 시장관리상 필요한 경우에는 그 때마다 거래소가 지정하는 자로 한다.</p>	<p>제81조(시장조성 상품·종목·기간)</p> <p>① (현행과 같음)</p> <p>② ----- ----- -- <u>시장조성계약으로 정한 종목으로 하며,</u> ----- ----- ----- ----- ----- -----</p> <p>③~④ (현행과 같음)</p> <p>[별표 1] 시장조성자 선정 기준 기초자산기준가격 (제2조제1호 관련)</p> <p>(이하 중간 현행과 같음)</p> <p>비고 1. ----- ----- -----<u>레피니티브(Refinitiv)</u>----- ----- -----</p>

가. 삭제<2015.10.28>

나. 삭제<2015.10.28>

2.~4. (생략)

[별표 12] 통화선물이론가격

통화선물(미국달러선물, 엔선물,
유로선물, 위안선물 및
미국달러플렉스선물)이론가격
(제55조제1항 관련)

(이하 산식 생략)

(이하 중간 생략)

r : 다음 각 호의 금리를 선형보간하여 산출
된 금리

1. 거래소가 지정하는 국제적인 정보통
신서비스제공자가 전일의 미국달러 현물
환거래의 종료시점을 기준으로 고시하는
1개월, 3개월, 6개월, 12개월 만기 외환
스왑포인트(매수호가와 매도호가의 평균
값을 100으로 나누어 환산한다)에 내재
된 원화금리(통화선물 이론가격 계산식
을 활용하여 산출하고 소숫점 셋째자리
에서 반올림한 원화금리를 말한다)

2. 거래소가 지정하는 통화스왑금리정보
제공자가 전일의 미국달러 현물환거래의
종료시점을 기준으로 고시하는 2년, 3년
만기 이중통화스왑금리(매수호가와 매도
호가의 평균금리로 소숫점 셋째자리에서
반올림한다)

r_f : 미국달러선물 및 미국달러플렉스선물 -
다음 각 호의 금리를 선형보간하여 산

2.~4. (현행과 같음)

[별표 12] 통화선물이론가격

통화선물(미국달러선물, 엔선물,
유로선물, 위안선물 및
미국달러플렉스선물)이론가격
(제55조제1항 관련)

(이하 산식 현행과 같음)

(이하 중간 현행과 같음)

r : -----

1. -----

----- 공표 -----

2. -----

----- 공표 -----

r_f : -----

거래소가 지정하는 국제적인 정보통신

출된 금리

- 1. IBA에서 발표하는 1개월, 3개월, 6개월, 12개월 만기 런던은행간 매도금리(LIBOR)
- 2. 거래소가 지정하는 국제적인 정보통신서비스제공자가 전일의 미국달러 현물환거래의 종료시점을 기준으로 고시하는 2년, 3년 만기 미국달러화이자율스왑금리[매수호가와 매도호가의 평균금리에 각 2년, 3년 만기 런던은행간 매도금리(LIBOR) 3개월/6개월 베이스스 스왑(Basis Swap) 매수호가와 매도호가의 평균금리를 가산한 금리로 소숫점 셋째자리에서 반올림한다

(이하 중간 생략)

비고 1. “거래소가 지정하는 국제적인 정보통신서비스제공자”는 로이터(Reuters)로 한다. 다만, 이론가 산출을 위한 금리적용과 관련하여 천재지변 등 불가항력적인 상황으로 정보서비스의 이용이 불가능할 경우에는 거래소가 별도로 정하는 바에 의한다.

2.~3. (생략)

[별표 17] 미국달러옵션이론가격
미국달러옵션이론가격
(제57조제1항 관련)

(이하 산식 생략)

(이하 중간 생략)

서비스제공자가 전일의 미국달러 현물환거래의 종료시점을 기준으로 거래소에 제공하는 1개월, 3개월, 6개월, 12개월, 2년, 3년 만기 USD SOFR OIS(Ove rnight Index Swap) 금리(매수호가와 매도호가의 평균금리로 소숫점 셋째자리에서 반올림한다)를 선행보간하여 산출된 금리

(이하 중간 현행과 같음)

비고 1. ----- 레피
----- 니티브(Refinitiv)-----

2.~3. (현행과 같음)

[별표 17] 미국달러옵션이론가격
미국달러옵션이론가격
(제57조제1항 관련)

(이하 산식 현행과 같음)

(이하 중간 현행과 같음)

r : 거래소가 지정하는 국제적인 정보통신 서비스제공자가 전일의 미국달러 현물 환거래의 종료시점을 기준으로 고시하는 1개월, 3개월, 6개월 만기 외환스왑 포인트(매수호가와 매도호가의 평균값을 100으로 나누어 환산한다)에 내재된 원화금리(별표 12의 통화선물 이론가격 계산식을 활용하여 산출하고 소숫점 셋째자리에서 반올림한 원화금리를 말한다)를 선형보간하여 산출된 금리

r_f : IBA에서 발표하는 1개월, 3개월, 6개월 만기 런던은행간 매도금리(LIBOR)를 선형보간하여 산출된 금리

(이하 중간 생략)

비고 1. “거래소가 지정하는 국제적인 정보통신서비스제공자”는 로이터(Reuters)로 한다. 다만, 이론가 산출을 위한 금리적용과 관련하여 천재지변 등 불가항력적인 상황으로 정보서비스의 이용이 불가능할 경우에는 거래소가 별도로 정하는 바에 의한다.

2. (생략)

r : -----

----- 공표 -----

r_f : 거래소가 지정하는 국제적인 정보통신 서비스제공자가 전일의 미국달러 현물 환거래의 종료시점을 기준으로 거래소에 제공하는 1개월, 3개월, 6개월 만기 USD SOFR OIS(Overnight Index Swap) 금리(매수호가와 매도호가의 평균금리로 소숫점 셋째자리에서 반올림한다)를 선형보간하여 산출된 금리

(이하 중간 현행과 같음)

----- 레피니티브(Refinitiv) -----

2. (현행과 같음)

<p>[별표 20] 기초자산에 상당하는 금액의 산정 가격</p> <p>기초자산에 상당하는 금액의 산정 가격</p> <p>(제112조 관련)</p> <p>(이하 중간 생략)</p> <p>비고 1. 제3호 및 제4호의 “거래소가 지정하는 국제적인 정보통신서비스제공자”는 <u>로이터(Reuters)</u>로 한다. 다만, 시장관리상 필요한 경우에는 그때마다 거래소가 지정하는 자로 한다.</p> <p>2. (생략)</p>	<p>[별표 20] 기초자산에 상당하는 금액의 산정 가격</p> <p>기초자산에 상당하는 금액의 산정 가격</p> <p>(제112조 관련)</p> <p>(이하 중간 현행과 같음)</p> <p>-----</p> <p>-----</p> <p>-----<u>레피니티브(Refinitiv)</u>-----</p> <p>-----</p> <p>-----</p> <p>-----</p> <p>2. (현행과 같음)</p>
---	--