

공 개



의안번호	제 136 호
의 결 연 월 일	2021. 6. 2. (제 11 차)

의
결
사
항

한국거래소 장외파생상품 청산업무규정
일부개정규정 승인안

증권선물위원회회의 안건

제 출 자	위원장 도 규 상
제출 연월일	2021. 6. 2.

1. 의결주문

한국거래소(이하 “거래소”) 장외파생상품 청산업무규정 일부개정규정 승인안을 별지와 같이 의결한다.

2. 제안이유

표준화·규격화되어 있는 장내거래와 달리, 장외파생상품은 거래간 상계가 어려워 신규계약 누적에 따라 청산잔고가 지속적으로 증가하고 있어, 청산회원의 효율적 리스크관리 및 포트폴리오 운영부담 완화를 위해 거래축약 제도를 도입하고자 함

3. 주요골자

가. 장외파생상품 계약의 축약 제도 근거를 신설하고 축약 업무절차의 세부사항을 세칙에서 정하도록 위임근거를 마련 (안 제98조)

나. 축약의 신청에 관한 내역 등 청산정보의 보관 및 관리 관련 조문 정비 (안 제126조)

4. 참고사항

가. 한국거래소 장외파생상품 청산업무규정 일부개정규정안 : <별지>

나. 한국거래소 장외파생상품 청산업무규정 일부개정규정안 신·구조문대비표 : <별첨>

한국거래소 장외파생상품 청산업무규정 일부개정규정안

장외파생상품 청산업무규정 일부를 다음과 같이 개정한다.

제8장의 제목 중 “조기종료, 당사자변경”을 “계약변경”으로 한다.

제8장 제1절의 제목 중 “조기종료 및 당사자변경”을 “계약변경”으로 한다.

제98조의 제목 중 “조기종료 및 당사자변경”을 “계약변경”으로 하고, 같은 조 제1항 중 “청산약정거래 계약금액의 전부 또는 일부에 대하여 계약만기가 도래하기 전에 종료(이하 “조기종료”라 한다) 하거나 청산약정거래에 대한 거래소의 일방 당사자를 변경(이하 “당사자변경”이라 한다)하고자 하는 경우 거래소에 조기종료 또는 당사자변경(이하 “계약변경”이라 한다)”를 “청산약정거래의 내용을 변경(이하 “계약변경”이라 한다)하고자 하는 경우 거래소에 계약변경”으로 하며, 같은 조 제3항을 삭제하고, 같은 조 제2항을 제3항으로 하며, 같은 조 제4항 중 “신청방법”을 “신청일, 신청시간, 신청방법”으로 하고, 같은 조에 제2항을 다음과 같이 신설한다.

② 제1항의 계약변경은 다음 각 호와 같이 구분한다.

1. 축약 : 복수의 청산약정거래를 대상으로 계약만기가 도래하기 전에 계약의 종료 및 계약금액 등의 변경을 통하여 기존 청산약정거래의 규모를 축소하는 것
2. 조기종료 : 단일 청산약정거래를 대상으로 계약만기가 도래하기 전에 계약금액의 전부 또는 일부에 관한 거래를 종료하는 것
3. 당사자변경 : 청산약정거래에 대한 거래소의 일방 당사자를 변경하는 것

제126조제1항제2호 중 “조기종료 및 당사자변경”을 “계약변경”으로 한다.

부 칙

이 규정은 거래소장외파생상품청산시스템 및 회원장외파생상품청산시스템의 프로그램 개발에 필요한 기간 등을 고려하여 세칙으로 정하는 날부터 시행한다.

신·구조문대비표

현행	개정안
제8장 청산약정거래의 <u>조기종료</u> , <u>당사자변경</u> 및 이관	제8장 청산약정거래의 <u>계약변경</u> 및 이관
제1절 청산약정거래의 <u>조기종료</u> 및 <u>당사자변경</u>	제1절 청산약정거래의 <u>계약변경</u>
제98조(<u>조기종료</u> 및 <u>당사자변경</u> 의 신청) ① 청산회원은 <u>청산약정거</u> <u>래 계약금액의 전부 또는 일부에</u> <u>대하여 계약만기가 도래하기 전에</u> <u>종료(이하 “조기종료”라 한다) 하</u> <u>거나 청산약정거래에 대한 거래소</u> <u>의 일방 당사자를 변경(이하 “당</u> <u>사자변경”이라 한다)하고자 하는</u> <u>경우 거래소에 조기종료 또는 당</u> <u>사자변경(이하 “계약변경”이라 한</u> <u>다)의 신청을 하여야 한다.</u>	제98조(<u>계약변경</u> ----- ----) ① ----- <u>청산약정거</u> <u>래의 내용을 변경(이하 “계약변</u> <u>경”이라 한다)하고자 하는 경우</u> <u>거래소에 계약변경-----</u> <u>-----.</u>
<신 설>	② 제1항의 <u>계약변경은 다음 각</u> <u>호와 같이 구분한다.</u> 1. <u>축약</u> : <u>복수의 청산약정거래를</u> <u>대상으로 계약만기가 도래하기</u> <u>전에 계약의 종료 및 계약금액</u> <u>등의 변경을 통하여 기존 청산</u> <u>약정거래의 규모를 축소하는 것</u> 2. <u>조기종료</u> : <u>단일 청산약정거래</u>

② (생략)

③ 청산약정거래의 계약변경의 신청시간은 9시부터 17시까지로 한다.

④ 계약변경의 신청방법, 요건 및 접수·등록, 그 밖에 필요한 사항은 세칙으로 정한다.

제126조(청산정보의 보관·관리 및 보고) ① 거래소는 청산업무의 수행 중에 발생한 다음 각 호의 내용(이하 “청산정보”라 한다)을 자기디스크, 자기테이프, 그 밖의 보조기록장치에 기록하여 발생일로부터 10년간 기록·유지한다.

1. (생략)

2. 조기종료 및 당사자변경의 신청에 관한 내역

3. ~ 5. (생략)

② (생략)

를 대상으로 계약만기가 도래하기 전에 계약금액의 전부 또는 일부에 관한 거래를 종료하는 것

3. 당사자변경 : 청산약정거래에 대한 거래소의 일방 당사자를 변경하는 것

③ (현행 제2항과 같음)
(삭제)

④ ----- 신청일, 신청시간, 신청방법-----
-----.

제126조(청산정보의 보관·관리 및 보고) ① -----

-----.

1. (현행과 같음)

2. 계약변경-----

3. ~ 5. (현행과 같음)

② (현행과 같음)

< 의안 소관 부서명 >

	금융위원회
소관부서	자본시장과
연 락 처	02-2100-2651