

유렉스(Eurex)연계선물거래 위험고지 및 설명서

◆ 본 약관, 고지서, 설명서는 관계법규에 따라 고객이 금융투자회사와 유렉스(Eurex)연계선물 계좌설정 계약을 체결하기 전에 유렉스(Eurex)연계선물 거래에 따른 위험을 사전에 충분히 인지할 수 있도록 금융투자회사가 고객에게 교부하는 것입니다.

I. 거래유의사항

유렉스(Eurex)연계선물 거래는 그 구조나 위험 등에 있어서 현물(주식, 채권, 외환, 일반상품 등)거래 및 국내시장의 코스피 200 선물, 미니코스피 200 선물 또는 코스피 200옵션 또는 미국달러선물과 다른 특성을 가지고 있습니다. 따라서 유렉스(Eurex)연계선물 거래를 행하시려는 고객께서는 동 거래의 구조나 위험성 및 투자 목적, 자금규모, 투자경험 등에 대한 다음의 사항을 고려하여 유렉스(Eurex)연계선물 거래를 행하여 주시기 바랍니다.

1. 투자경험, 투자목적, 재정상태 등을 고려하여 투자하는가?
2. 투자원금이나 투자원금을 초과하는 손실을 부담할 수 있는 경제적 능력이나 용의가 있는가?
3. 유렉스(Eurex)연계선물거래의 상품구조와 거래개시 이후 내가 준수해야할 의무를 이해하고 있는가?
4. 회사의 파생상품투자상담사가 내게 제공하는 해당 유렉스(Eurex)연계선물 거래 설명서 및 위험고지서를 철저히 검토함으로써 내가 직면하게 될 위험 등을 충분히 이해하고 있는가?
5. 유렉스(Eurex)연계선물 거래를 시작한 후 문제가 발생하거나 의문점이 생길 경우 상담할 수 있는 사람이나 부서 등을 알고 있는가?

본 위험고지서 및 설명서의 목적은 유렉스(Eurex)연계선물 거래를 하려는 고객에게 유렉스(Eurex)연계선물 거래에 대한 일반적인 정보를 제공하고 아울러 고객이 거래를 시작하기 전에 더 많은 정보를 숙지하고 금융투자회사의 파생상품투자상담사에게 심도 있는 상담을 요청함으로써 고객의 상황에 맞는 투자를 행하도록 독려하는 것입니다.

II. 유렉스(Eurex)연계선물 위험고지서

1. 유렉스(Eurex)연계선물이라 함은 독일의 유렉스(Eurex)의 규정 및 한국거래소의 파생상품시장 업무규정에 따라 유렉스와 한국거래소파생상품시장에서 이루어지는 1일물 유렉스(Eurex)연계선물거래 및 코스피 200 선물, 미니코스피 200 선물, 코스피

200 옵션, [미국달러선물](#)거래를 말합니다.

2. 유렉스(Eurex)연계선물 거래는 유렉스(Eurex)연계선물 거래와 한국거래소간 거래가 결합된 거래로서 높은 위험성을 수반합니다. 유렉스(Eurex)연계선물 매수 미결제약정 보유자는 그 기초자산인 코스피 200 선물, 미니코스피 200 선물, 코스피 200 옵션, [미국달러선물](#)을 매수할 의무를 부담합니다. 반대로 유렉스(Eurex)연계선물 매도 미결제약정 보유자는 그 기초자산인 코스피 200선물, 미니코스피 200 선물, 코스피 200 옵션, [미국달러선물](#)을 매도할 의무를 부담합니다.

3. 유렉스(Eurex)연계선물의 결제대금을 정하여진 기한까지 예탁하지 아니하는 경우에, 회사는 고객의 위탁증거금으로 예탁된 대용증권, 현금 또는 외화의 전부 또는 일부를 처분하여 결제대금에 충당하며 이로 인하여 발생하는 손실은 고객이 부담하여야 합니다.

4. 장개시전협의거래를 통하여 유렉스연계선물을 거래함에 있어 고객의 위탁증거금 예탁총액이 부족한 경우 회사는 장개시전 협의거래를 수탁 거부할 수 있습니다. 이로 인하여 발생하는 손실은 고객이 부담하여야 합니다.

5. 유렉스시장의 상황에 따라 유렉스가 장중 위탁증거금 추가 예탁, 포지션 제한 등 제도 변경이 있을 수 있으며, 관련법규에 근거하여 귀하의 거래한도에 제한이 있는 경우 귀하는 이를 준수하여야 합니다.

6. 유렉스시장의 가격급등락 등 시장상황 및 시장조치 등에 따라서는 귀하가 원하는 거래가 체결되지 못하거나 또는 원하지 않은 가격으로 거래가 체결될 수 있습니다. 예를 들면 유렉스가 가격급변(Fast Market) 상황을 선언하는 경우 시장조성자의 호가가 제한될 수 있으며 이 경우 신규거래의 체결 또는 미결제약정의 해소가 곤란할 수 있습니다.

7. 거래체결 시 회사는 체결내용을 별도로 정한 방법에 의하여 통지하게 되므로 통지된 내용(잔액·잔량 등의 사항)은 반드시 확인하시기 바랍니다.

8. 귀하가 유렉스(Eurex)연계선물 및 코스피 200 선물, 미니코스피 200 선물, 코스피 200 옵션, [미국달러선물](#) 거래를 위하여 예탁한 재산은 이를 수탁한 회사에 대해서만 반환을 청구할 수 있으며, 예탁재산은 예금자보호법에 의한 보호대상이 아닙니다.

9. 유렉스시장의 해외파생상품시장회원 또는 해외파생상품중개인 또는 회사의 결제불이행, 파산 등의 경우에 귀하의 직접적인 귀책사유 없이 귀하의 재산 전부 또는 일부가 상실되거나 반환이 지체될 수 있으므로 귀하는 회사와 그 회사의 해외파생상품시장회원 또는 해외파생상품중개인의 선정에 신중을 기하여야 합니다.

10. 유렉스(Eurex)연계선물 거래는 회사와 해외파생상품시장회원 또는 해외파생상품중개인 또는 독립적인 주문중개업자를 통하여 거래가 이루어지기 때문에 갑작스런 전산장애, 인터넷장애 등으로 인한 거래장애가 발생할 수 있습니다. 이 경우에는 원활한 주문체결이 불가능할 수도 있습니다.

11. 회사를 통하여 이루어지는 유렉스(Eurex)연계선물 거래는 독일 유렉스와의 지리

적인 차이로 인하여 가격정보 획득, 주문처리 속도 등 제반 거래여건이 불리합니다.
12. 유렉스(Eurex)연계선물 위험고지서 및 거래설명서에 명시되지 않은 사항으로서 일반적으로 장내파생상품거래에 수반되는 위험은 기존의 장내파생상품거래 위험고지서의 내용이 적용됩니다.

위 사항들은 유렉스(Eurex)연계선물 거래에 수반되는 모든 위험·제도 및 장내파생상품거래와 관련하여 귀하가 알아야 할 사항을 간략하게 서술한 것으로 귀하의 유렉스(Eurex)연계선물 거래와 관련하여 발생할 수 있는 모든 위험과 중요 사항을 전부 기술한 것은 아닙니다, 따라서 상세한 내용은 회사에게 확인하여야 합니다.

또한 이 고지서는 유렉스(Eurex)연계선물거래계좌설정약관 및 파생상품계좌설정약관의 내용이나 국내외 관계법규 등에 우선하지 못한다는 점을 양지하시기 바랍니다.

Ⅲ .유렉스(Eurex)연계선물 거래설명서

1. 유렉스(Eurex)연계선물거래의 정의

유렉스(Eurex)연계선물 거래는 유렉스(EUREX) 거래소에 상장된 코스피 200 선물, 미니코스피 200 선물, 코스피 200 옵션, **미국달러선물**을 기초자산으로 하는 1 일 만기 선물을 일정의 증거금(위탁증거금)을 납입하고 매수 또는 매도하는 선물 거래입니다. 또한, 동 상품은 한국거래소에 상장된 코스피 200 선물, 미니코스피 200 선물, 코스피 200 옵션, **미국달러선물**을 거래대상으로 하며, 거래기준가격 및 만기 시 미결제약정의 협의매매 등이 한국거래소의 코스피 200 선물, 미니코스피 200선물, 코스피 200 옵션, **미국달러선물**과 연계되어 처리가 되어 한국거래소의 코스피 200 선물, 미니코스피200 선물, 코스피 200 옵션, **미국달러선물**의 야간 시장 성격을 갖게 됩니다.

2. 상품 주요내용

(1) 계좌개설 및 거래신청

- ▶ 유렉스(Eurex)연계선물 거래를 희망하는 모든 투자자는 사전에 당사 국내파생상품계좌를 개설하여야 합니다.
- ▶ 유렉스(Eurex)연계선물 거래 신청/해지는 온라인 또는 내방 등을 통해 가능하며, 신청/해지 신청 시 추가적인 참여 변경이 없을 경우 최종적인 상태를 유지합니다.
- ▶ 유렉스(Eurex)연계선물 거래 해지는 유렉스(Eurex)연계선물의 당일 체결이 있거나, 미체결주문이 존재할 경우 처리 불가합니다.

(2) 기초자산 및 거래수량단위

- ▶ 유렉스(Eurex)연계선물 거래는 코스피 200 선물, 미니코스피 200 선물, 코스피

200 옵션, **미국달러선물**을 기초자산으로 하는 1 일 만기 선물입니다.

▶ 거래수량단위는 1 계약이며, 1 계약의 금액은 가격에 거래승수를 곱하여 산출되는 금액입니다.

▶ 거래승수는 파생상품시장 업무규정 시행세칙에 따라 적용됩니다.

(3) 상장종목

▶ 상장종목은 한국거래소의 정규시장에 상장된 코스피 200 선물, 미니코스피 200 선물, 코스피 200 옵션, **미국달러선물** 종목 중 익거래일에도 상장되는 전 종목입니다.

(4) 기준가격

▶ 기준가격은 한국거래소에서 장 종료 후 산출하는 익일 기준가이며, 유렉스(Eurex)연계선물거래는 기준가격으로 결제대금이 산출됩니다.

(5) 매매시간, 매매기준일 및 휴장일

▶ 유렉스(Eurex)연계선물거래 매매시간은 한국시간 기준 18:00 ~ 05:00 입니다. (단, 유럽서머타임 적용 기간에는 04:00 에 종료)

▶ 유렉스(Eurex)연계선물거래 매매일은 매 거래가 시작되는 18:00 의 익영업일로 표기 됩니다.

(6) 호가가격단위

▶ 코스피 200 선물 : 0.05 포인트

▶ 미니코스피 200 선물 : 0.02 포인트

▶ 코스피 200 옵션 : 호가의 가격이 10 포인트 이상인 경우 0.05 포인트, 호가의 가격이 10 포인트 미만인 경우 0.01 포인트

▶ **미국달러선물 : 0.1 포인트**

(7) 가격제한폭

▶ **코스피 200 선물, 미니코스피 200, 코스피 200 옵션**

선물 거래소에서 제시하는 익영업일의 주간시장 가격 제한폭 ① $\pm 8\%$, ② $\pm 15\%$ ③ $\pm 20\%$ 중에서 ③단계 $\pm 20\%$ 로 제한

▶ **미국달러선물**

선물 거래소에서 제시하는 익영업일의 주간시장 가격 제한폭 $\pm 4\%$

(8) 계약수량한도

▶ 없음

※ 단, 회사의 리스크 관리를 위하여 일일 순포지션 계약수량이 제한될 수 있음

(9) 최종거래일 및 최종결제시간

▶ 최종거래일은 상장 당일이며, 야간거래가 종료되는 익일 05 시(유럽서머타임 적용 시 04 시)까지 거래 가능합니다.

▶ 최종결제시간은 야간거래 종료 후 정규시장 동시호가 시작 전까지 입니다.

(10) 만기결제 방법

▶ 유렉스(Eurex)연계선물거래 만기결제방법은 현금결제방식과 실물결제방식으로

이원화된 구조입니다.

- 현금결제: 당일 발생한 매매차익 (미결제약정은 체결가격과 기준가격의 차액결제)
- 실물결제: 순미결제약정을 한국거래소에서 코스피 200 선물, 미니코스피 200 선물, 코스피 200 옵션, **미국달러선물** 매수/매도 포지션으로 실물인수도 (인수도 방식은 장개시전 협의거래방식임)

▶ 최종결제가격은 한국거래소의 종목별 기준가격이며, 결제통화는 원화(KRW)입니다.

▶ 유렉스(Eurex)연계선물은 모두 1 일물 선물이지만, 당사 HTS, MTS, 홈페이지에는 만기일을 기초자산의 만기일로 표시하오니, 거래에 참고하시기 바랍니다.

3. 증거금 제도

(1) 기본예탁금, 위탁증거금, 현금위탁증거금비율 등

▶ 유렉스(Eurex)연계선물 계좌의 모든 증거금은 국내파생상품계좌로 통합되어 관리되며, 국내파생상품계좌의 증거금은 국내시장과 동일한 방식으로 적용됩니다.

(2) 위탁증거금의 지급/충당 및 추가예탁 등

▶ 유렉스(Eurex)연계선물 거래로 발생한 위탁증거금의 지급/충당 및 추가예탁 의무는 국내파생상품계좌로 반영되어 한국거래소 규정에 따릅니다.

(3) 위탁증거금의 부족 또는 추가예탁 불이행시의 조치

▶ 고객은 장개시전협의거래를 수행함에 있어 국내파생상품계좌의 위탁증거금 평가예탁충액이 당해 주문을 수탁하기에 부족한 경우가 발생할 수 있습니다.

▶ 이 경우에 고객이 7 시 30 분까지 부족한 금액을 별도로 추가예탁하지 않더라도 회사는 유렉스연계 야간거래의 장개시전협의거래 주문을 정상적으로 처리하고 그 부족한 금액을 정규시장과 합산하여 위탁증거금에 반영합니다.

4. 결제 제도

(1) 현금결제

▶ 유렉스(Eurex)연계선물 전용계좌의 체결건에 대해 약정가격과 최종결제가격(당일 한국시장에서의 기준가격) 차를 원화로 결제합니다.

- 매도 : (매도가격 - 최종결제가격) × 수량 × 거래승수

- 매수 : (최종결제가격 - 매수가격) × 수량 × 거래승수

▶ 당사는 매 야간거래 종료 후 협의거래 시작 전까지 확정된 결제차금과 수수료를 국내파생상품계좌로 입출금 처리합니다.

(2) 실물 인수도

▶ 유렉스(Eurex)연계선물 거래가 종료된 후 보유중인 순미결제약정은 다음영업일 국내파생상품계좌로 협의거래를 통해 이전 처리합니다.

5. 매매비용

(1) 매매수수료

▶ 유렉스(Eurex)연계선물 수수료는 회사가 사전에 안내한 수수료에 따릅니다.

[홈페이지(www.eugenefutures.com)>고객센터 >업무안내 > 수수료 및 예탁금이용료]

▶ 주간 코스피 200 선물, 미니코스피 200 선물, 코스피 200 옵션, **미국달러선물**과 수수료가 다를 수 있으니, 거래 전 유선상담을 통하여 정확한 수수료를 확인하시기 바랍니다.

(2) 시세이용료

▶ 유렉스(Eurex)연계선물은 해당거래소의 규정에 따라 실시간시세 이용료를 부과할 수 있습니다.

6. 유렉스(Eurex)연계선물 거래시 유의사항

(1) 전산장애 시 유의사항

▶ 전산시스템을 이용한 거래는 하드웨어 및 소프트웨어의 고장 등 시스템과 관련된 위험이 있으며, 시스템 고장으로 요구대로 주문이 이루어지지 않거나 주문자체가 이루어지지 않을 수 있습니다.

▶ 유렉스(Eurex)연계선물 거래는 해외거래소, 해외파생상품시장회원 또는 해외파생상품중 개인을 통해 거래가 이루어지기 때문에 갑작스런 전산장애, 네트워크장애 등으로 인한 거래 장애가 발생할 수 있으며, 회사는 회사의 귀책사유가 아닌 경우 고객에게 발생하는 손해에 대한 책임을 지지 않습니다.

※ 이 경우 회사는 야간거래 데스크 (야간데스크 전화번호(02-3771-8973~5)가 바뀔 수 있사오니 홈페이지를 참조하시기 바랍니다) 등을 통해 최선을 다해 고객의 주문을 처리할 것이나, 원활한 주문체결이 불가능 할 수도 있습니다.

(2) 비상시 거래시간의 변경

▶ 당사는 한국거래소의 시장운영상의 장애로 인한 국내파생상품계좌 결제정보의 확정이 늦어질 경우, 유렉스(Eurex)연계선물 거래 시간을 변경할 수 있습니다.

(3) 결제조건의 변경

▶ 유렉스 시장에서의 천재지변, 전쟁, 사변 또는 급격한 변동 및 기타 이에 준하는 사태의 발생으로 인하여 거래가 정상적으로 이루어지기 어려운 경우 결제 조건이 변경될 수 있습니다.

(4) 양도소득세 분리과세

▶ 파생상품은 국내/국외로 구분해서 양도소득세를 적용하며, 유렉스(Eurex)연계선물은 국외 파생상품으로 적용됨을 유의하시기 바랍니다.

(5) 전량 정정 및 전량 취소 유의사항

▶ 유렉스 거래소와 한국거래소의 체결통보 관리방식 차이에 따라, 전량 정정 및 전량 취소 시 미체결수량의 차이가 발생할 수 있으니 주문 후에는 미체결 내역을 재조회하시기 바랍니다.

(6) 주문접수의 제한

▶ 유렉스 시장의 가격 급등락 등 시장상황 및 시장 조치 등에 따라서 원하는 거래가 체결되지 못하거나 또는 원하지 않은 가격으로 체결될 수 있습니다.

예를 들면 유렉스 거래소가 가격 급변(Fast Market) 상황을 선언하는 경우 시장조성자의 호가가 제한될 수 있으며, 이 경우 신규거래의 체결 또는 미결제약정의 청산이 불가할 수 있습니다.

▶ 유렉스 거래소 제도인 Price-Not-Reasonable-Check 에 의해 주문 시 매수호가 또는 매도호가 옵션기준가 또는 옵션 현재가와 괴리율이 기준율을 벗어나면 주문이 거부됩니다.

(7) 착오거래 구제

▶ 시장이 급변하는 등의 사유로 유렉스(Eurex)거래소의 착오거래 구제 규정에서 정한 정상거래 범위를 벗어난 경우 유렉스(Eurex)거래소에서 일방적으로 체결 취소 혹은 유렉스(Eurex)거래소에서 정한 시장 적정가격으로 체결가가 정정될 수 있습니다. 유렉스 거래소는 시장 참여자들이 착오로 인하여 시장 가격과 현저히 동떨어진 체결로 인한 대량손실로부터 보호하기 위하여 착오거래 구제 제도를 가지고 있습니다.

(8) 불공정거래에 관련 유의사항

▶ EUREX거래소에서는 해외파생상품 불공정거래 감시를 실시하고 있으며, 규정 위반 시 관련 조사 및 고소, 고발, 벌금부과, 강제청산, 계좌폐쇄, 거래정지, 부당이익 환수 등의 제재를 받을 수 있습니다.

▶ 고객은 EUREX거래소의 규정 위반 조사에 성실히 임해야 하며, 개인정보 및 거래목적, 거래정황 등의 제공 요청을 받은 경우 해당 정보를 제공하여야 합니다.

▶ 불공정거래에 해당 하는 경우 EUREX야간거래를 수탁거부 할 수 있습니다.

◇ 주요 불공정 거래 유형

- 허수성 주문 : 체결을 목적으로 하지 않고 체결 전에 취소 및 정정을 목적으로 하는 주문
- 가장매매 : 동일 주체(개인 또는 법인)가 같은 종목에 대하여 매수와 매도주문을 동시에 넣으로써 그 주식의 매매가 활발한 것으로 보이게 하거나 자신의 의도대로 시세를 조종하는 행위
- 결제가 또는 기준가 조작거래 : 가격 조작이나 가격 조작 시도
- 사전 협의 거래 : 시장참여자가 계좌 간 자금을 이전하기 위한 목적으로 사전 조정된 거래 또는 어떤 시장참여자도 일체의 매수, 매도 거래를 사전 조정하거나 사전 협의하여 비경쟁적인 거래를 실행하여서는 안됨
- 주문자 위반 : 주문을 입력하는 모든 주문 입력자는 거래소에서 고유의 ID로 식별될 수 있어야 하며 해당ID를 다른 주문입력자와 공유해서는 안됨