

당일 선물 시황은 새벽 미 증시 결과를 반영하여 작성되는 '선물옵션 모닝브리프' 를 참조할 것
 대우증권 홈페이지(www.bestez.com) > 리서치 > 모닝브리프 > 선물옵션

주가지수선물 가격정보

	KOSPI200	912	1003	1006	KSPDCE3S
기 준 가 격	204.25	204.05	202.90	203.65	-1.75
시 가	204.49	203.85	203.30	202.25	-1.70
고 가	204.93	204.85	203.30	202.25	-1.70
저 가	202.95	202.60	201.00	202.25	-1.75
총 가	203.13	202.80	201.10	202.25	-1.75
전 일 대 비	-1.12	-1.25	-1.80	-1.40	-
이 른 가 격	-	203.72	203.18	204.46	-0.54
총 약 정 수 량 *	78,935	286,699	178	-	201
총 약 정 금 액 **	3,014,557	29,203,425	17,988	-	40,767
미 결 제 약 정	-	110775 (1093)	3791 (107)	178 (0)	-
배 당 지 수 ***	2.79% (CD금리)	0.00	1.96	2.09	-
반 응 배 수		1.14	1.16	-	
장 증 평 균 베 이 시 스		-0.155			
전 일 대 비		-0.300			

주: 단위 (* 천주, 계약 ** 백만 *** 포인트)

반응배수 = 일중 선물가격변동폭/일중 현물가격변동폭, SP 191CS : 9월물과 12월물과의 스프레드를 의미함
 장증 평균 베이스는 1분 평균이며, 만기익일의 경우 전일대비는 직전 최근월물과의 비교이므로 의미없음

주가지수선물 투자자별 매매현황

		외국인	개인	증권	보험	투신	은행	종금/기금	기타
	매 수	53,661	91,125	131,349	202	4,137	2,596	3,314	493
	매 도	58,312	90,571	130,793	192	2,824	758	3,090	337
	비 중	19.5%	31.7%	45.7%	0.1%	1.2%	0.6%	1.1%	0.1%
순 매 수 누 적	전 일	-4,651	554	556	10	1,313	1,838	224	156
	누 적	-16,243	5,640	3,275	42	5,053	1,953	780	-500
매 매 편 향 강 도		-4.15%	0.30%	0.21%	2.54%	18.86%	54.80%	3.50%	18.80%

주 : 누적은 지난 트리플위칭데이 이후부터 현시점까지 당일 순매수 미결제약정의 증감을 누적한 것임

매매편향강도(%)=(순매수/(매수+매도))X100, 절대수치가 클수록 단방향으로의 집중력이 높다는 의미임

ETF 가격정보

		전일대비	등락율	거래량	거래대금	외국인보유	KOSSEF KODEX200		
KOSSEF		-125	-0.01%	40155	819085	0.00%	NAV (ETF-NAV)%	20347.52	20482.54
KODEX200		-145	-0.01%	1425951	29294348	0.00%		2045979%	2059796%
		KOSSEF	KODEX200	합성현물	최근월물	합성선물	T/E	0.2%	0.8%
증가/100		203.2	205	206.05	202.80	206.19	설정주수	0	2000000
eff.delta		1.12	1.29	3.03	1.12	3.05	환매주수	400000	1300000
diff/basis		0.03%	0.70%	1.44%	-0.33	3.06	상장주수	3950000	66100000

주 1 : effective delta(유효델타) = ETF등 전일대비 증감분/KOSPI200 전일대비 증감분

2 : 합성현물 = (C-P)+X exp[-rt], 합성선물 = (C-P)exp[rt]+X

3 : 괴리/베이스스 - KOSPI200 대비 괴리율/베이스스

4 : TE(tracking error)=[(NAV/(KOSPI200X100))-1]X100(%)

주가지수옵션 가격정보

대 표	0.214	콜평균	0.178	풋평균	0.242	역사적 (5일)	13.5	역사적 (20일)	18.4
내 재 변 동 성									
월 물 행 사 가 격		0911					0912		
		207.5	205.0	202.5	200.0	197.5	205.0	202.5	200.0
Call	가 격	3.00	4.20	6.05	7.65	9.60	7.10	9.10	10.25
	전 일 대 비	-0.65	-0.90	-0.70	-0.90	-1.10	-0.90	-0.60	-1.20
	내 재 변 동 성	20.00	19.00	20.50	18.00	12.00	20.80	20.00	21.00
	거 래 량	63,985	27,625	5,327	2,246	256	623	231	56
	미 결 제	72,861	58,407	25,647	11,192	2,316	7,240	886	12,991
Put	가 격	4.50	3.15	2.36	1.65	1.14	5.95	5.05	4.15
	전 일 대 비	0.40	0.10	0.21	0.19	0.09	-0.45	0.20	0.15
	내 재 변 동 성	26.30	25.50	26.60	26.90	27.40	25.50	26.30	26.50
	거 래 량	99,989	596,203	672,634	971,078	757,695	14,550	2,664	4,789
	미 결 제	51,090	104,017	67,853	154,708	127,624	23,663	16,081	53,492

주 : 역사적 변동성, 내재변동성 등은 CHECK II 단말기를 기준으로 한 것임

주가지수옵션 투자자별 매매현황

Call		외국인	개인	증권	보험	투신	은행	종금/기금	기타
	매 수	2,367,899	2,319,705	2,742,495	0	50,321	22,624	61,992	3,269
	매 도	2,337,643	2,290,044	2,771,308	0	34,438	46,942	85,736	2,194
	비 중	31.1%	30.5%	36.4%	0.0%	0.6%	0.5%	1.0%	0.0%
순매수 누적	전 일	30,256	29,661	-28,813	0	15,883	-24,318	-23,744	1,075
	누 적	113,290	395,047	-344,172	0	5,904	-70,923	-83,995	-15,151
Put		외국인	개인	증권	보험	투신	은행	종금/기금	기타
	매 수	2,431,559	1,942,359	980,802	0	32,829	5,016	16,915	946
	매 도	2,445,015	1,910,223	995,183	0	33,347	7,428	17,489	1,741
	비 중	45.1%	35.6%	18.3%	0.0%	0.6%	0.1%	0.3%	0.0%
순매수 누적	전 일	-13,456	32,136	-14,381	0	-518	-2,412	-574	-795
	누 적	322,405	-181,330	-65,897	0	-24,242	-9,870	-36,765	-4,301

주 : 누적은 직전 옵션만기일 이후부터 당일 순매수 미결제약정 증감을 누적한 것임.

차익거래 잔고와 프로그램 매매 동향

		주 식		주 가지 수 선 물		주 가지 수 CALL 옵션		주 가지 수 PUT 옵션	
		매도	매수	매도	매수	매도	매수	매도	매수
차 익 거 래 잔 고 (백 만 원)	최근 월 물	5,973,680	6,780,794	6,806,679	5,992,085	240	-	-	287
	기 타	-	-	-	-	-	-	-	-
	합 계	5,973,680	6,780,794	6,806,679	5,992,085	240	0	0	287
프 로 그 램 매 매 동 향 (백 만 원)	차 익 비 차 의 합 계	프 로 그 램 매 도				프 로 그 램 매 수			
		주 식 거 래 량		주 식 거 래 대 금		주 식 거 래 량		주 식 거 래 대 금	
		수 량	비 율 (%)	금 액	비 율 (%)	수 량	비 율 (%)	금 액	비 율 (%)
		5,812	2.13	294,491	8.17	1,371	0.50	71,209	1.98
10,429	3.83	355,408	9.86	9,302	3.41	271,909	7.55		
16,241	5.96	649,899	18.04	10,673	3.91	343,118	9.52		
베 이 시 스 수 준	0.225	0.125	0.025	-0.075	-0.175	-0.275	-0.375	-0.475	
차 익 성 순 매 수	-256	-6380	-23890	-7617	-74928	-67755	-13250	181	

주 : 월요일을 제외한 차익거래 잔고는 1일 지연된 데이터임.

본 조사는 고객의 투자 참고용으로 작성된 것이며, 당시의 리서치센터가 신뢰할 수 있는 자료 및 정보로부터 얻어진 것이나 당시가 그 정확성이나 완전성을 보장할 수 없으므로 어떠한 경우에도 고객의 증권투자 결과에 대한 법적 책임소재의 증빙자료로 사용될 수 없습니다. 본 조사는 당시의 허락없이 무단 복제 및 배포 할 수 없습니다.