

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

주가지수선물 가격정보

	KOSPI200	912	1003	1006	KSPDCE3S
기 준 가 격	207.18	205.75	204.75	204.15	-1.75
시 가	205.57	205.70	204.75	202.95	-1.80
고 가	206.12	205.75	204.75	202.95	-1.80
저 가	203.34	203.05	201.50	202.95	-1.90
총 가	203.52	203.45	201.80	202.95	-1.80
전 일 대 비	-3.66	-2.30	-2.95	-1.20	-0.05
이 른 가 격	-	204.08	203.54	204.83	-0.54
총 약 정 수 량 *	76,429	279,446	340	-	492
총 약 정 금 액 **	2,938,567	28,526,307	34,416	-	100,214
미 결 제 약 정	-	113388 (-1379)	4257 (332)	178 (0)	-
배 당 지 수 ***	2.79% (CD금리)	0.00	1.96	2.09	-
반 응 배 수		0.97	1.17	-	
장 증 평 균 베 이 시 스		-0.381			
전 일 대 비		-0.107			

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	68,086	88,942	112,106	371	5,268	1,921	2,507	585
	매 도	66,268	91,239	113,507	365	3,870	1,047	2,861	629
	비 중	24.0%	32.2%	40.3%	0.1%	1.6%	0.5%	1.0%	0.2%
순 매 수 누 적	전 일	1,818	-2,297	-1,401	6	1,398	874	-354	-44
	누 적	-18,409	4,593	2,798	50	6,582	3,934	821	-369
매 매 편 향 강 도		1.35%	-1.27%	-0.62%	0.82%	15.30%	29.45%	-6.59%	-3.62%

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		-310	-0.02%	8943	182993	0.00%	NAV (ETF-NAV)%	20386.45 20519.19
KODEX200		-335	-0.02%	1296502	26710146	0.00%		2075294% 2089046%
		KOSSEF	KODEX200	합성현물	최근월물	합성선물	T/E	0.2% 0.8%
증가/100		204	205	206.08	203.45	206.19	설정주수	0 250000
eff.delta		0.85	0.92	1.61	0.63	1.61	환매주수	0 250000
diff/basis		0.24%	0.80%	1.26%	-0.07	2.67	상장주수	1200000 3800000

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

대내재변동성	표	0.217	콜평균	0.197	풋평균	0.229	역사적(5일)	22.5	역사적(20일)	20.3
월물 행사가격		0911					0912			
		207.5	205.0	202.5	200.0	197.5	205.0	202.5	200.0	
Call	가격	3.00	4.20	6.05	7.65	9.60	7.10	9.10	10.25	
	전일 대비	-0.65	-0.90	-0.70	-0.90	-1.10	-0.90	-0.60	-1.20	
	내재변동성	20.00	19.00	20.50	18.00	12.00	20.80	20.00	21.00	
	거래량	63,985	27,625	5,327	2,246	256	623	231	56	
	미결제	83,266	69,325	31,642	12,395	3,520	8,070	1,196	13,411	
Put	가격	4.50	3.15	2.36	1.65	1.14	5.95	5.05	4.15	
	전일 대비	0.40	0.10	0.21	0.19	0.09	-0.45	0.20	0.15	
	내재변동성	26.30	25.50	26.60	26.90	27.40	25.50	26.30	26.50	
	거래량	99,989	596,203	672,634	971,078	757,695	14,550	2,664	4,789	
	미결제	50,830	106,516	73,198	156,568	164,334	23,944	16,462	64,975	

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

주가지수옵션 투자자별 매매현황

Call		외국인	개인	증권	보험	투신	은행	종금/기금	기타
	매수	2,321,139	2,380,188	2,802,403	0	45,642	40,516	75,964	3,097
	매도	2,309,513	2,292,605	2,861,946	0	36,410	59,493	107,346	1,636
	비중	30.2%	30.5%	36.9%	0.0%	0.5%	0.7%	1.2%	0.0%
순매수 누적	전일	11,626	87,583	-59,543	0	9,232	-18,977	-31,382	1,461
	누적	206,669	470,728	-421,138	0	16,460	-125,072	-134,460	-13,187
Put		외국인	개인	증권	보험	투신	은행	종금/기금	기타
	매수	2,809,735	2,465,692	1,456,302	0	26,939	81,751	150,282	1,965
	매도	2,848,959	2,418,044	1,439,570	0	23,262	93,635	167,884	1,312
	비중	40.5%	34.9%	20.7%	0.0%	0.4%	1.3%	2.3%	0.0%
순매수 누적	전일	-39,224	47,648	16,732	0	3,677	-11,884	-17,602	653
	누적	352,566	-89,743	-135,066	0	-18,158	-33,598	-70,446	-5,555

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

차익거래 잔고와 프로그램 매매 동향

	주식	주가지수선물		주가지수 CALL옵션		주가지수 PUT옵션			
		매도	매수	매도	매수	매도	매수		
차익거래 잔고 (백만원)	최근월물	6,271,308	6,660,753	6,686,452	6,289,920	240	-	-	287
	기타	-	-	-	-	-	-	-	-
	합계	6,271,308	6,660,753	6,686,452	6,289,920	240	0	0	287
프로그램 매매 동향 (백만원)	프로그램 매도				프로그램 매수				
	주식 거래량		주식 거래대금		주식 거래량		주식 거래대금		
	수량	비율(%)	금액	비율(%)	수량	비율(%)	금액	비율(%)	
프로그램 매매 동향 (백만원)	차익	9,714	4.77	492,134	14.73	1,508	0.74	77,131	2.31
	비차익	8,161	4.01	249,564	7.47	9,111	4.48	227,153	6.80
	합계	17,876	8.78	741,698	22.20	10,620	5.22	304,285	9.11
베이스스 수준	-0.125	-0.225	-0.325	-0.425	-0.525	-0.625	-0.725	-0.825	
차익성 순매수	1988	-30976	-117584	-143292	-99937	-28150	-5456	0	

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 당사의 허락없이 무단 복제 및 배포 할 수 없습니다.