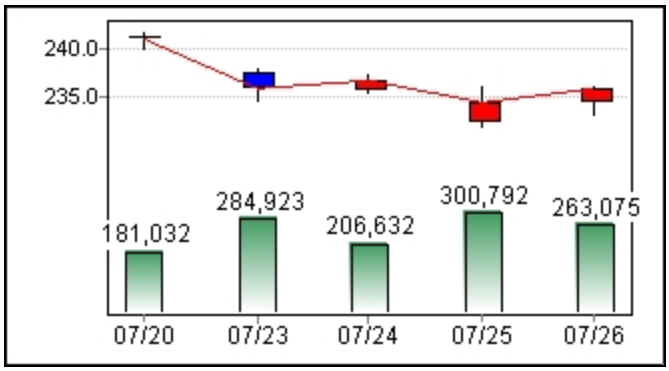
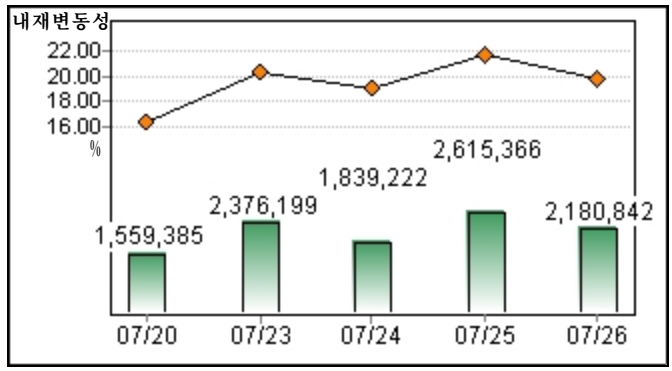
파생상품시장 일일동향

파생상품시장본부 2012-07-26

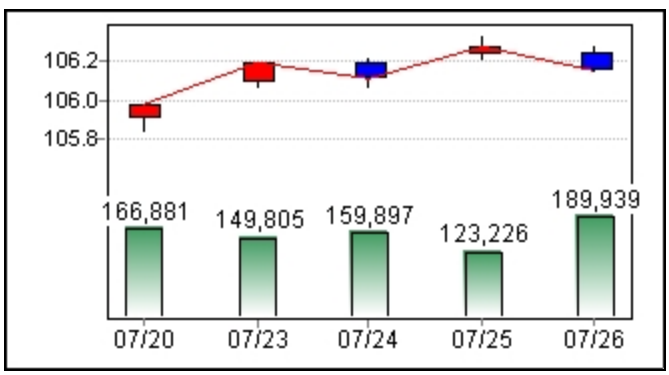
<코스피200 선물> (계약)



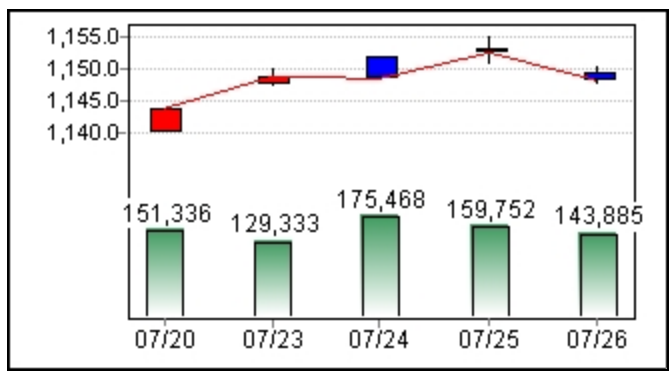
<코스피200 옵션> (계약)



<3년국채 선물> (계약)



<미국달러 선물> (계약)



<근월물 가격동향> (단위 : P, 원)

품목	시가	고가	저가	종가	대비
코스피200선물	234.30	236.30	233.20	235.95	1.45
신3년국채 선물	106.25	106.29	106.15	106.15	-0.13
미국달러선물	1,149.30	1,150.60	1,147.70	1,148.00	-4.50
엔선물	1,472.70	1,473.70	1,469.50	1,470.00	-5.80
유로선물	1,393.00	1,393.00	1,393.00	1,393.00	1.40
돈육선물	0.00	0.00	0.00	4,110.00	0.00

<품목별 거래동향> (단위 : 계약, 억원)

품목	거래량	대비	거래대금	미결제약정
코스피200선물	263,075	-37,717	308,905	111,749
주식선물	548,914	31,758	2,678	592,309
신3년국채선물	189,939	66,713	201,754	247,237
미국달러선물	143,885	-15,867	16,533	555,259
엔선물	94	-497	14	19,141
유로선물	4	-48	1	3,174
돈육선물	0	0	0	0
코스피200옵션	2,180,842	-434,524	13,060	792,874
장개시전협의거래	39,222	5,674	247	-
합 계	3,425,882	-379,337	613,253	2,347,831

* 합계는 전체 품목 기준

<종목별 가격동향>

(단위 : Point)

품목	종목	시가	고가	저가	종가	대비
코스피200선물	코스피200 F 201209	234.30	236.30	233.20	235.95	1.45
	코스피200 F 201212	236.55	237.15	235.00	237.10	1.50
3년국채선물	신3년국채 F 201209	106.25	106.29	106.15	106.15	-0.13
	신3년국채 F 201212	0.00	0.00	0.00	106.43	0.00
미국달러선물	미국달러 F 201208	1,149.30	1,150.60	1,147.70	1,148.00	-4.50
	미국달러 F 201209	0.00	0.00	0.00	1,154.30	0.00
	미국달러 F 201210	0.00	0.00	0.00	1,155.80	0.00
엔선물	엔 F 201208	1,472.70	1,473.70	1,469.50	1,470.00	-5.80
	엔 F 201209	0.00	0.00	0.00	1,478.20	0.00
	엔 F 201210	0.00	0.00	0.00	1,480.30	0.00
유로선물	유로 F 201208	1,393.00	1,393.00	1,393.00	1,393.00	1.40
	유로 F 201209	0.00	0.00	0.00	1,393.80	0.00
	유로 F 201210	0.00	0.00	0.00	1,395.50	0.00
돈육선물	돈육 F 201208	0.00	0.00	0.00	4,110.00	0.00
	돈육 F 201209	0.00	0.00	0.00	4,110.00	0.00
코스피200옵션	콜옵션	4.90	5.80	4.25	5.70	0.70
	풋옵션	3.45	4.05	2.64	2.75	-0.85

* 옵션시세는 콜/풋 최근월물 ATM기준

<종목별 거래동향>

(단위 : 계약, 백만원)

품목	종목	거래량	대비	거래대금	대비	미결제약정	대비
코스피200선물	코스피200 F 201209	263,027	-37,435	30,884,815	-4,290,369	106,449	-1,669
	코스피200 F 201212	48	-282	5,675	-33,135	4,177	12
3년국채선물	신3년국채 F 201209	189,939	66,713	20,175,418	7,080,673	247,237	-4,707
	신3년국채 F 201212	0	0	0	0	0	0
미국달러선물	미국달러 F 201208	143,485	-16,249	1,648,656	-192,926	505,938	-7,736
	미국달러 F 201209	400	382	4,606	4,398	48,921	400
	미국달러 F 201210	0	0	0	0	400	0
엔선물	엔 F 201208	94	-497	1,383	-7,339	19,141	0
	엔 F 201209	0	0	0	0	0	0
	엔 F 201210	0	0	0	0	0	0
유로선물	유로 F 201208	4	-48	56	-669	2,501	-4
	유로 F 201209	0	0	0	0	673	0
	유로 F 201210	0	0	0	0	0	0
돈육선물	돈육 F 201208	0	0	0	0	0	0
	돈육 F 201209	0	0	0	0	0	0
코스피200옵션	콜옵션	1,291,592	-335,977	623,049	-121,692	476,445	19,163
	풋옵션	889,250	-98,547	682,995	-258,325	316,429	24,414

<투자자별 거래비중>

(단위 : %)

코스피200선물	외국인	35.0	금융투자	32.9	개인	28.2
주식선물	개인	56.1	기타법인	16.6	외국인	16.3
3년국채선물	금융투자	69.4	은행	14.1	외국인	10.7
미국달러선물	금융투자	51.0	외국인	25.0	개인	9.8
엔선물	개인	59.0	투신	20.7	금융투자	20.2
유로선물	금융투자	50.0	투신	50.0	보험	0.0
돈육선물	금융투자	0.0	보험	0.0	투신	0.0
코스피200옵션	외국인	55.9	개인	30.1	금융투자	12.5
장개시전협의거래	개인	66.9	기타법인	22.3	은행	5.5

<투자자별 매매현황>

(단위 : 계약, 백만원)

구분		증권선물	은행	투신	보험	기타	개인	외국인
코스피200 선물	매수	86,612	1,328	3,412	782	5,873	74,463	90,605
	매도	86,400	1,118	3,085	762	4,097	74,098	93,515
	순매수	212	210	327	20	1,776	365	-2,910
주식 선물	매수	43,101	22	2,349	36	112,516	303,737	87,153
	매도	35,862	3	4,088	46	105,362	311,792	91,761
	순매수	7,239	19	-1,739	-10	7,154	-8,055	-4,608
3년국채 선물	매수	136,554	23,226	2,372	2,326	1,470	6,608	17,383
	매도	127,156	30,301	1,628	782	961	5,723	23,388
	순매수	9,398	-7,075	744	1,544	509	885	-6,005
미국달러 선물	매수	71,634	12,213	955	431	5,480	14,231	38,941
	매도	75,015	15,842	269	400	5,600	13,881	32,878
	순매수	-3,381	-3,629	686	31	-120	350	6,063
엔 선물	매수	0	0	39	0	0	55	0
	매도	38	0	0	0	0	56	0
	순매수	-38	0	39	0	0	-1	0
돈육 선물	매수	0	0	0	0	0	0	0
	매도	0	0	0	0	0	0	0
	순매수	0	0	0	0	0	0	0
유로 선물	매수	4	0	0	0	0	0	0
	매도	0	0	4	0	0	0	0
	순매수	4	0	-4	0	0	0	0
코스피200 옵션	매수	164,761	87	1,008	3,527	14,685	392,398	729,579
	매도	162,526	31	740	3,508	13,922	393,733	731,584
	순매수	2,235	55	268	18	763	-1,335	-2,005
장개시전협의거래	매수	296	732	542	0	2,759	8,043	0
	매도	67	636	407	0	2,757	8,506	0
	순매수	229	97	135	0	3	-463	0

* 선물은 거래량, 옵션은 거래대금 기준

<협의거래 현황>

(단위 : 계약)

협의대량거래	EFP거래	FLEX거래	합계
2,000	3	0	2,003

<협의대량거래 세부내용>

(단위 : 계약)

미국달러							
USD F 201208	USD F 201209	USD F 201210	USD F 201211	USD F 201212	USD F 201301	USD F 201303	USD F 201306
2,000	0	0	0	0	0	0	0
엔							
JPY F 201208	JPY F 201209	JPY F 201210	JPY F 201211	JPY F 201212	JPY F 201301	JPY F 201303	JPY F 201306
0	0	0	0	0	0	0	0
유로							
EUR F 201208	EUR F 201209	EUR F 201210	EUR F 201211	EUR F 201212	EUR F 201301	EUR F 201303	EUR F 201306
0	0	0	0	0	0	0	0
3년국채							
(N)KTB3 F 201209				(N)KTB3 F 201212			
0				0			

<차익거래 현황>

구분	매도차익거래		매수차익거래		순매수잔고 (만주, 억원)
	수량(만주)	금액(억원)	수량(만주)	금액(억원)	
금일매매	134	722	215	1,269	-2,864
잔고	15,420	78,565	12,556	75,047	-3,518

* 차익거래 현황은 전일 기준

<코스피200 선물 베이시스>

(단위 : P,%)

시장베이시스	0.62
이론베이시스	1.01
이론가 괴리율	0.00
시장 스프레드	1.15
이론 스프레드	1.87

* 시장스프레드 = 차근월물 시장가 - 최근월물 시장가

** 이론스프레드 = 근월물 이론가 - 최근월물 이론가

<코스피200 옵션변동성>

(단위 : %)

콜평균 내재변동성	18.80
풋평균 내재변동성	22.30
대표 내재변동성	19.80
역사적변동성(20일)	19.30

<코스피200 옵션변동성>

P/C Ratio	0.69

<시황개요>

【코스피200 선물】

□ 전일 미국 증시는 세계 최대 중장비업체인 캐터필러와 항공기 제조업체인 보잉사의 실적 호조에 힘입어 강한 상승세로 시작하였으나 신규 주택판매 부진과 애플의 실적 부진 전망에 혼조세 연출했으며, 금일 국내 지수선물은 기관의 적극적인 매수세로 전일 대비 1.45p(0.62%) 상승한

□ 거래량은 전일 대비 37,717계약 감소한 263,075계약을 기록

【코스피200 옵션】

□ 콜풋별 P/C Ratio는 0.69이고 행사가격대별로 콜옵션은 237.5~255.0p, 풋옵션은 217.5~232.5p에서 거래가 집중되었으며,콜 내재변동성은 18.6%, 풋 내재변동성은 23.9%, 90일 역사적 변동성은 18.4% 기록

□ 거래량은 전일 대비 434,524계약 감소한 2,180,842계약을 기록

【3년국채 선물】

□ 전일 미 국채금리 상승 영향으로 하락 출발하였으며, 이후 유로존 우려 완화로 국내 증시가 반등에 성공하고, 지속적인 외국인 매도세로 인해 하락폭을 확대한 끝에 전일보다 13틱 하락한 106.15로 마감

□ 거래량은 전일대비 66,713계약 증가한 189,939계약을 기록

【미국달러 선물】

□ 밤 사이 유럽 중앙은행이 영구구제기금을 마련할 것이라는 전망이 나오면서 유로화가 가파르게 상승하여 유럽과 미국의 증시 낙폭을 줄인채 혼조세로 마감하였고 코스피 지수도 상승하면서 전일 대비 4.5원 하락한 1,148.0원에 거래를 마감

□ 거래량은 전일 대비 15,867계약 감소한 143,885계약을 기록

<시황재료>

○ 주식시장 : 기관 매수

○ 채권시장 : 미 국채금리 상승, 유로존 우려 완화

○ 외환시장 : 코스피 상승