

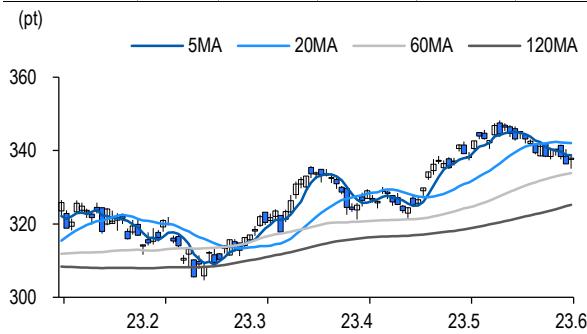


선물옵션시장 지표

2023.7.3

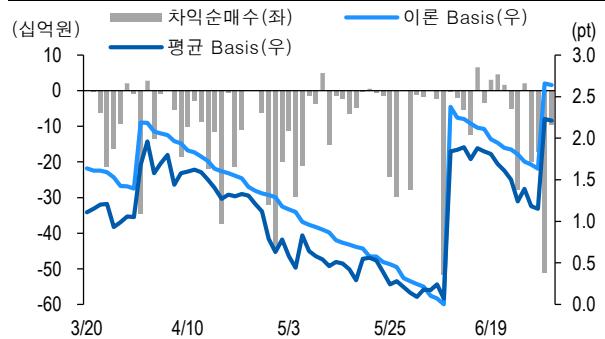
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	337.95	0.46	1.56	5,392.0	-
선물 9월물	340.50	0.38	1.30	19,501.9	281,342
선물 12월물	342.40	0.43	1.45	30.8	26,211
7월물(mini)	338.74	0.36	1.22	1,420.7	105,695
8월물(mini)	339.24	0.30	1.00	3.9	15,435



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.64	2.21	2.55	-0.13%
베이시스(mini)	0.45	0.46	0.79	0.00%
제1스프레드(SP)	2.34	1.80	1.80	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.45	0.75	0.75	0.09%



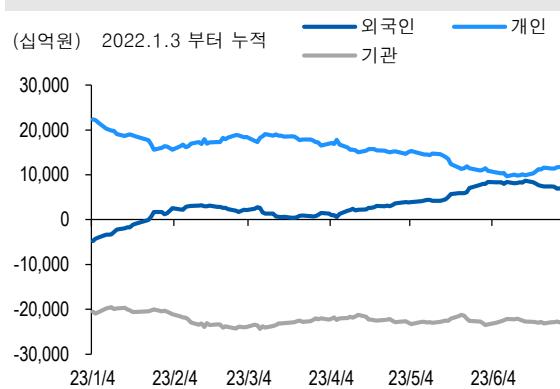
투자주체별 매매 동향

(십억원)

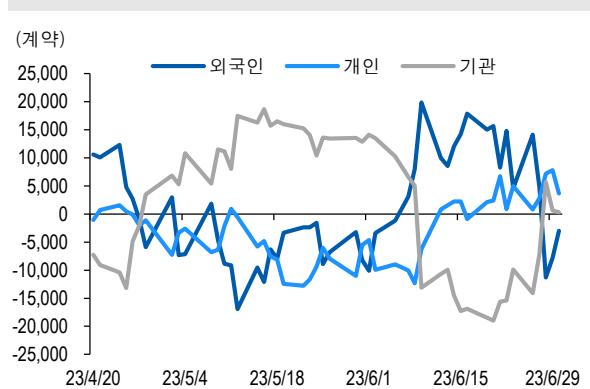
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-158.7	1.1	-157.6	0.0	-31.8	410.5	1.8	-0.4	0.6	-2.6
개인	-68.4	-9.7	-78.1	0.0	17.9	-341.6	-11.1	-1.1	0.9	15.6
기관	203.0	6.8	209.9	-9.5	2.4	-41.6	9.5	2.2	-1.7	-13.7
금융투자	180.7	-41.2	139.5	-8.4	4.2	1.9	5.8	2.3	-1.6	-21.0
투신	3.8	-6.3	-2.5	0.0	-9.7	-68.5	2.7	-0.2	0.0	9.9
은행+보험+기타금융	11.1	35.7	46.8	0.0	6.2	19.7	1.0	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	48.3	18.9	67.2	0.0	7.3	5.4	0.0	0.0	0.0	-2.5
기타법인	24.1	0.5	24.6	0.0	2.3	-27.3	-0.2	-0.6	0.1	0.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	887,817	207.4	1,016,941	11.0%	지수옵션 전체	1,662,464	405.6	2,511,985
Put	774,647	198.2	1,495,044	11.3%	PCR(금액기준)	0.96	VKOSPI	12.59%(-0.34%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	345.0(K+3)	0.74	0.07	155,589	30,797	1,516	10.9	340.0(K+1)
	342.5(K+2)	1.36	0.18	161,747	22,443	485	11.1	337.5(K+0)
	340.0(K+1)	2.27	0.29	130,175	21,703	2,647	11.3	335.0(K-1)
	337.5(K+0)	3.54	0.47	46,913	10,240	1,433	11.6	332.5(K-2)
	335.0(K-1)	5.16	0.67	10,290	5,950	909	12.0	330.0(K-3)
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	340.0(K+1)	3.57	-0.88	12,767	23,303	-410	10.3	
	337.5(K+0)	2.34	-0.76	54,074	22,984	-1,231	10.6	
	335.0(K-1)	1.49	-0.52	114,299	30,563	247	11.0	
	332.5(K-2)	0.89	-0.41	111,202	21,377	959	11.3	
	330.0(K-3)	0.51	-0.27	127,741	35,573	-159	11.6	

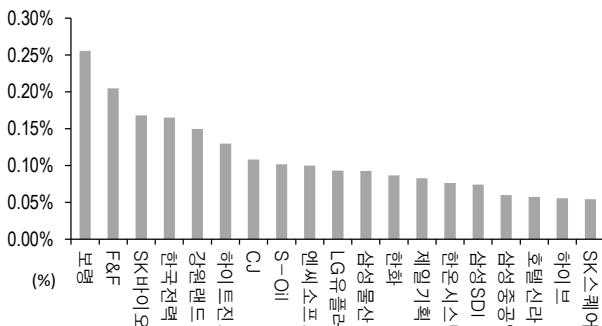
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	(계약, 십억원)	
주식선물 전체	3,108,133	2,226.3	5,169,950	61,342	59,370	29,664	-90,857	-2.6	15.6	-13.7		
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수(%)	개인순매수(%)	기관순매수(%)	금융투자순매수(%)	
삼성전기	144,500	0.49	20.9	82.4	11,008	267	-0.05%	-239	-17	256	286	-135
넥센타이어	8,240	1.60	1.1	77.8	3,510	-1,227	-0.23%	-1,833	-63	1,895	1,895	0
HD 한국조선해양	116,900	1.83	26.8	73.3	16,121	704	-0.03%	297	253	-587	-888	301
SK 하이닉스	115,600	-0.77	211.4	71.9	186,275	-5,155	-0.06%	-3,946	-2,066	6,722	10,752	-3,920
한화에어로	127,400	1.59	55.8	71.4	20,195	409	-0.16%	-3,447	320	3,103	2,411	689
삼성전자	72,300	-0.55	567.4	69.4	1,205,732	-9,852	0.03%	-4,127	16,999	-13,006	-13,923	1,167
SK	149,000	-0.13	15.5	67.0	20,248	-137	0.03%	1,053	-110	-938	-953	15
한국금융지주	51,800	1.97	3.2	64.6	15,525	636	-0.05%	41	162	-203	-193	-10
영원무역	63,900	2.40	9.0	63.0	10,903	861	-0.15%	2,294	-2,184	-109	-109	0
롯데케미칼	154,400	1.78	10.0	61.1	4,854	-422	-0.13%	-343	-133	476	659	-183

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터