

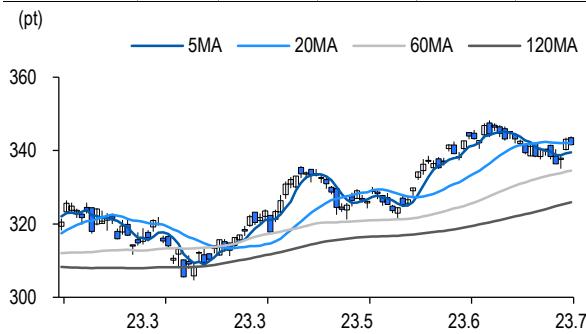


선물옵션시장 지표

2023.7.5

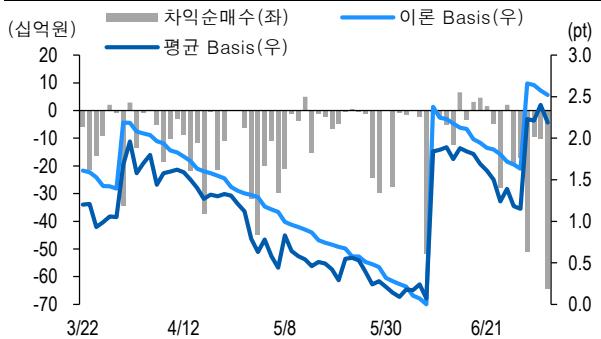
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	341.59	-0.43	-1.49	5,809.0	-
선물 9월물	343.85	-0.55	-1.90	13,723.3	285,247
선물 12월물	345.80	-0.49	-1.70	14.9	24,759
7월물(mini)	342.08	-0.53	-1.82	945.3	111,354
8월물(mini)	342.92	-0.50	-1.74	2.6	16,032



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.52	2.19	2.26	-0.10%
베이시스(mini)	0.32	0.41	0.49	0.03%
제1스프레드(SP)	2.37	1.84	1.85	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.32	0.52	0.52	0.06%



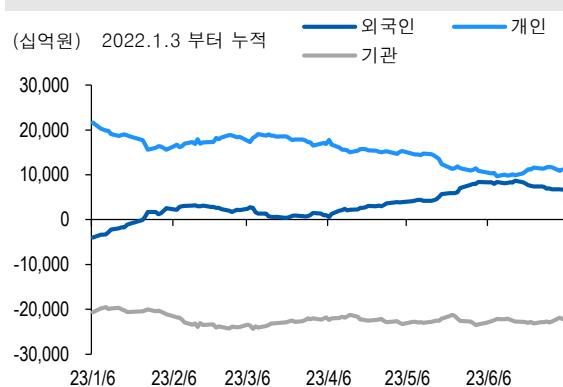
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-58.3	-8.7	-67.0	0.0	-55.9	-914.6	-27.6	2.3	3.6	-13.8
개인	304.7	-13.9	290.8	0.0	9.2	542.0	34.5	-4.4	-3.2	6.9
기관	-287.2	38.6	-248.6	-64.4	-204.0	316.9	-6.1	1.8	1.4	8.6
금융투자	7.3	80.7	88.0	-6.9	-2.8	639.1	-9.2	-0.2	1.4	-4.1
투신	-1.5	5.1	3.5	0.0	3.0	-262.8	2.3	0.0	0.0	13.2
은행+보험+기타금융	-4.8	-22.6	-27.5	0.0	-2.4	-44.6	0.8	1.9	0.0	0.3
연기금+국가지자체	-269.8	-38.5	-308.3	-51.2	-201.9	-14.7	0.0	0.0	0.0	-0.7
기타법인	40.8	-40.8	0.0	0.0	3.1	55.6	-0.7	0.3	-1.9	-1.8

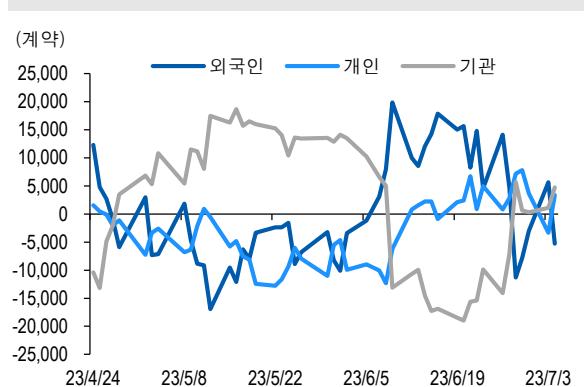
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	713,726	144.0	1,079,267	10.9%	지수옵션 전체	1,346,550	289.7
Put	632,824	145.7	1,574,125	10.9%	PCR(금액기준)	1.01	VKOSPI 12.27%(-0.46%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	350.0(K+3)	0.27	-0.44	125,112	34,195	945	10.7
	347.5(K+2)	0.65	-0.66	114,475	32,611	3,321	11.0
	345.0(K+1)	1.29	-0.94	105,896	31,201	498	11.2
	342.5(K+0)	2.26	-1.25	32,597	21,519	706	11.2
	340.0(K-1)	3.67	-1.52	12,036	22,512	-2,095	11.5
Put	345.0(K+1)	4.17	0.80	17,991	15,620	3,893	10.3
	342.5(K+0)	2.65	0.47	69,394	18,681	3,943	10.5
	340.0(K-1)	1.57	0.23	113,641	30,200	-912	10.7
	337.5(K-2)	0.87	0.10	113,668	23,746	25	11.1
	335.0(K-3)	0.44	0.03	81,942	31,450	2,648	11.3

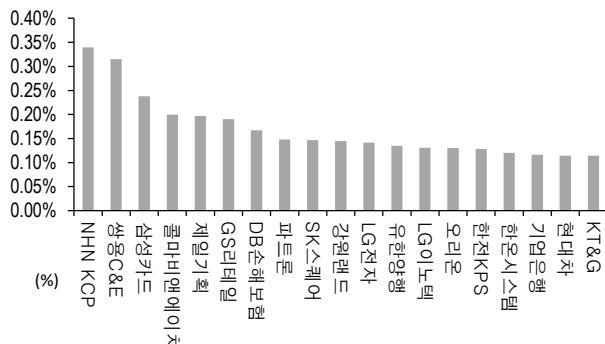
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)										
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	2,979,597	2,874.1	5,236,741	43,922	3,035	-5,451	2,650	-13.8	6.9	8.6
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
에스엠	109,500	2.34	24.0	79.6	36,431	-2,173	0.00%	-350	837	375
한화에어로	131,500	1.23	45.1	66.8	20,089	-474	-0.09%	-984	-920	1,891
SK 하이닉스	117,800	0.08	147.8	66.8	189,504	-2,165	-0.01%	3,374	-455	-2,904
삼성전자	73,100	0.00	498.0	66.7	1,217,090	12,497	0.08%	10,574	-9,386	-1,926
롯데케미칼	154,900	-2.09	8.9	66.6	4,553	320	-0.08%	-200	166	334
포스코퓨처엠	375,000	1.49	208.8	64.4	24,159	-671	-0.03%	-1,299	271	1,033
SK	147,900	-1.27	13.9	62.7	20,371	98	0.00%	-240	233	7
현대차	209,000	0.00	55.5	62.7	58,494	2,331	0.11%	1,141	1,643	-2,867
LG 전자	128,500	1.02	102.6	62.1	51,175	6,767	0.14%	-658	4,659	-4,247
롯데에너지	48,650	-2.11	10.6	59.5	32,793	-1,030	-0.05%	-831	-754	1,587

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터