

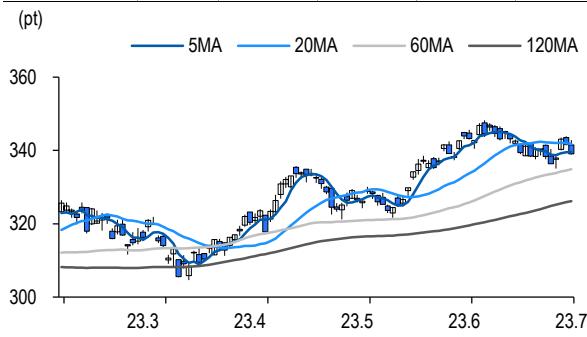


선물옵션시장 지표

2023.7.6

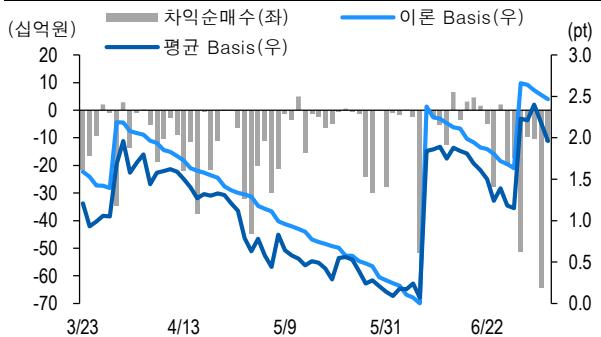
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	339.04	-0.75	-2.55	6,883.2	-
선물 9월물	340.60	-0.95	-3.25	17,511.4	295,119
선물 12월물	342.50	-0.95	-3.30	22.3	24,801
7월물(mini)	338.90	-0.93	-3.18	1,184.6	107,725
8월물(mini)	339.62	-0.96	-3.30	6.3	16,478



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.47	1.96	1.56	-0.15%
베이시스(mini)	0.28	0.24	-0.14	-0.01%
제1스프레드(SP)	2.35	1.85	1.85	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.28	-0.09	-0.09	-0.11%



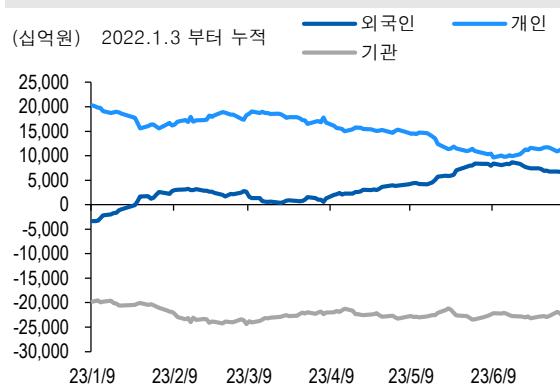
투자주체별 매매 동향

(십억원)

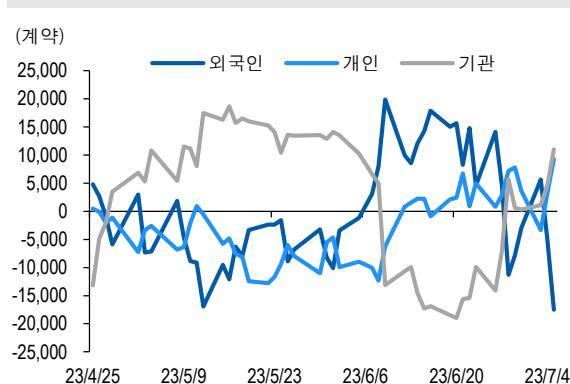
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	256.9	-10.2	246.7	0.0	247.4	-1,126.5	80.4	1.8	-3.0	-9.7
개인	325.0	44.3	369.3	0.0	0.8	498.7	8.3	-2.0	1.4	24.7
기관	-614.4	-36.1	-650.5	-11.3	-63.3	626.1	-90.1	0.3	1.7	-16.3
금융투자	-578.8	-77.5	-656.3	-5.5	-3.9	630.6	-88.9	-0.7	0.0	-24.6
투신	3.5	20.7	24.2	0.0	-10.8	59.5	0.6	-0.2	0.0	7.3
은행+보험+기타금융	-8.1	-2.6	-10.7	0.0	-1.2	-15.4	-1.7	1.2	1.7	0.1
연기금+국가지자체	-56.8	11.5	-45.3	-1.7	-37.9	-48.6	0.0	0.0	0.0	1.0
기타법인	32.5	0.8	33.3	0.0	1.4	1.7	1.4	-0.1	-0.1	1.3

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

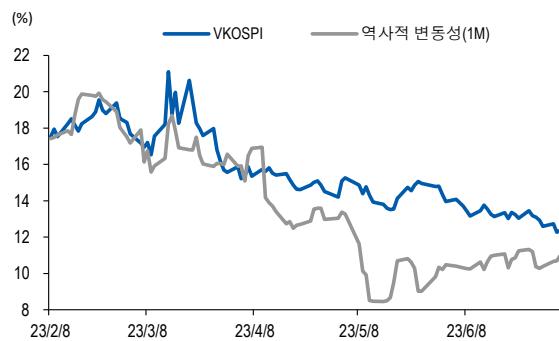
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)															
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	848,774	150.9	1,106,878	10.7%	지수옵션 전체	1,600,216	325.4	2,694,563							
Put	751,442	174.4	1,587,685	11.9%	PCR(금액기준)	1.16	VKOSPI	12.37%(+0.10%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	350.0(K+3)	0.09	-0.18	139,848	51,427	17,232	11.1	Put	345.0(K+1)	6.55	2.38	8,649	14,085	-1,535	13.5
	347.5(K+2)	0.21	-0.44	166,302	36,464	3,853	10.8		342.5(K+0)	4.50	1.85	34,027	20,000	1,319	12.4
	345.0(K+1)	0.49	-0.80	181,749	41,810	10,609	10.7		340.0(K-1)	2.90	1.33	94,502	32,145	1,945	12.1
	342.5(K+0)	0.95	-1.31	104,525	26,747	5,228	10.2		337.5(K-2)	1.69	0.82	141,813	21,760	-1,986	11.8
	340.0(K-1)	1.83	-1.84	49,668	23,652	1,140	10.1		335.0(K-3)	0.90	0.46	147,816	32,810	1,360	11.8

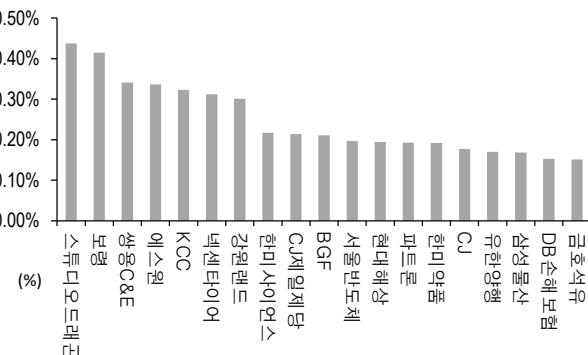
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,357,747	2,662.0	5,231,889	-4,852	-24,417	19,248	2,009	-9.7	24.7	-16.3	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수
넥센타이어	8,320	-1.19	0.7	100.6	5,321	1,694	0.31%	2,089	148	-2,236	-2,236
한화에어로	131,800	0.23	48.0	83.6	18,978	-1,111	-0.11%	-565	51	483	648
한세실업	20,700	-1.43	2.8	76.0	6,455	-283	0.11%	994	156	-1,150	-1,150
삼성전자	72,000	-1.50	637.4	75.7	1,219,536	2,446	0.05%	1,966	39,323	-44,453	-47,402
대한유화	139,300	1.31	4.4	74.8	3,531	285	0.12%	777	-51	-726	-726
삼성 SDI	709,000	-0.42	63.2	70.6	13,984	16	0.10%	94	89	-183	-280
현대차	205,500	-1.67	82.5	68.4	58,240	-254	0.06%	310	1,762	-2,093	-2,517
SK 하이닉스	116,500	-1.10	194.5	68.4	183,840	-5,664	0.00%	-4,425	-2,653	7,650	754
SK 이노베이션	167,100	0.42	66.1	67.0	22,077	-1,104	-0.09%	323	-18	-307	453
포스코퓨처엠	380,000	1.33	129.3	64.0	24,504	345	-0.04%	439	-473	39	93

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터