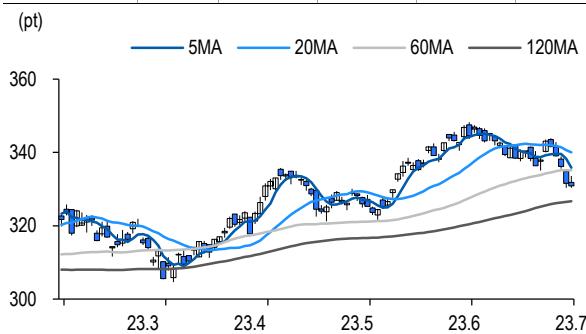


선물옵션시장 지표

2023.7.11

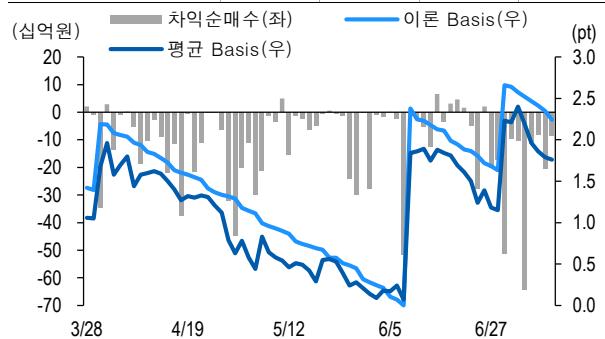
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	330.84	-0.22	-0.73	6,569.9	-
선물 9월물	332.85	0.00	0.00	23,369.8	289,803
선물 12월물	334.55	-0.04	-0.15	43.9	25,356
7월물(mini)	331.22	0.01	0.02	1,597.6	105,944
8월물(mini)	331.94	0.01	0.04	31.2	18,251



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.24	1.76	2.01	-0.15%
베이시스(mini)	0.10	0.03	0.38	-0.02%
제1스프레드(SP)	2.27	1.85	1.85	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	0.25	0.25	0.04%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-153.6	-18.0	-171.6	0.0	35.0	548.8	-33.7	3.2	-4.3	-17.3
개인	312.4	20.7	333.0	0.0	1.1	-262.5	-13.7	-1.8	3.4	-21.3
기관	-190.0	11.9	-178.1	-8.6	7.2	-279.7	48.2	-0.4	1.2	40.1
금융투자	-171.5	20.8	-150.7	-5.7	-1.4	-439.7	52.3	-0.2	1.3	11.9
투신	29.9	-12.8	17.1	0.0	-3.7	212.8	-0.6	-0.3	0.0	23.5
은행+보험+기타금융	9.2	-3.3	5.9	-2.3	-2.3	-52.9	-3.5	0.1	-0.1	-0.4
연기금+국가지자체	15.8	9.6	25.3	0.0	17.4	0.2	0.0	0.0	0.0	5.1
기타법인	31.2	0.9	32.1	0.0	-1.0	-6.7	-0.8	-0.9	-0.3	-1.6

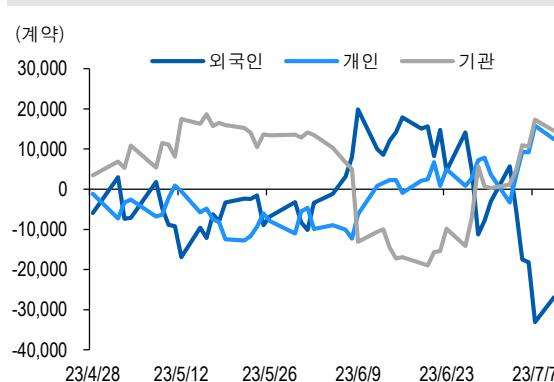
자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	1,884,861	329.7	1,335,438	13.7%	지수옵션 전체	4,110,111	755.8
Put	2,225,250	426.1	1,753,904	14.8%	PCR(금액기준)	1.29	VKOSPI 14.63%(+0.05%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	340.0(K+3)	0.05	-0.10	317,666	66,437	13,967	13.4	Put	335.0(K+1)	4.47	-0.22	38,413	29,655	-38	12.8
	337.5(K+2)	0.17	-0.24	373,333	46,101	11,902	13.3		332.5(K+0)	2.70	-0.36	198,873	28,183	5,313	13.3
	335.0(K+1)	0.52	-0.43	507,118	30,271	5,526	13.6		330.0(K-1)	1.53	-0.33	402,396	31,305	-766	14.3
	332.5(K+0)	1.29	-0.50	231,543	20,547	5,215	14.1		327.5(K-2)	0.78	-0.30	511,418	44,038	6,687	15.1
	330.0(K-1)	2.57	-0.50	54,717	9,443	3,380	14.8		325.0(K-3)	0.35	-0.21	410,506	41,004	845	15.5

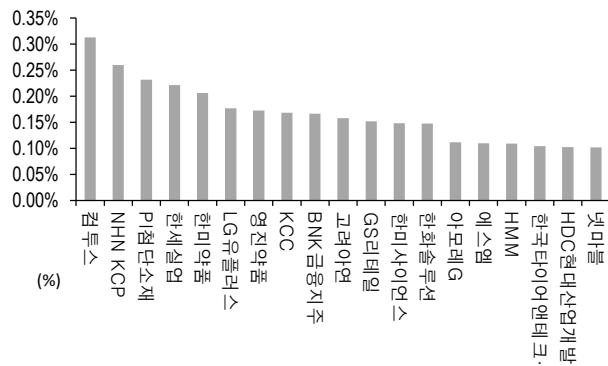
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,795,278	3,495.7	5,275,860	-36,385	4,568	-27,429	23,550	-17.3	-21.3	40.1
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
롯데에너지	51,900	-5.46	20.0	84.9	26,279	-3,818	-0.08%	-789	-1,549	2,300
삼성전자	69,500	-0.57	622.8	77.3	964,075	-169,853	-0.07%	15,494	-12,149	-2,620
LG 화학	653,000	-0.31	105.4	76.8	6,023	-1,015	0.03%	615	31	-647
롯데케미칼	151,300	0.20	9.9	74.9	2,861	-1,281	0.06%	433	-405	85
한국전력	19,500	-0.15	12.4	74.5	102,695	-14,218	0.06%	-5,282	3,675	1,607
SK 하이닉스	110,400	-1.60	253.5	73.1	162,535	-11,394	0.04%	308	-160	-140
SK	143,100	2.07	12.1	65.4	18,471	-860	0.08%	1,121	-146	-975
아모레퍼시픽	95,100	0.42	8.7	65.2	12,442	462	-0.01%	812	204	-1,016
현대차	205,500	0.74	67.1	64.1	46,582	-5,703	0.04%	-2,257	-71	2,278
NAVER	193,300	-0.87	60.1	62.2	33,476	-1,404	-0.02%	674	704	-1,378

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터