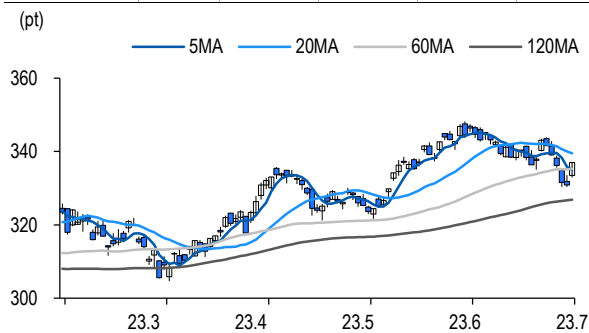


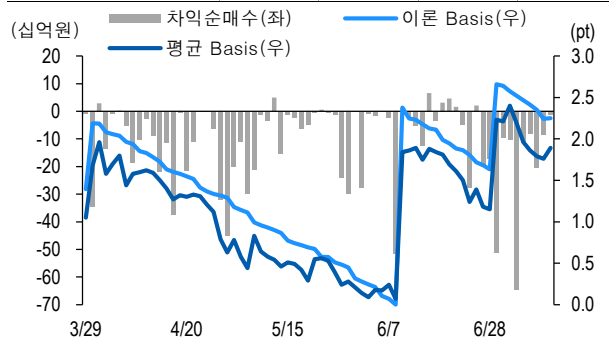
선물옵션시장 지표

2023.7.12

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	337.02	1.87	6.18	7,506.3	-
선물 9월물	338.85	1.80	6.00	20,084.9	287,586
선물 12월물	340.85	1.88	6.30	30.7	25,379
7월물(mini)	337.16	1.79	5.94	1,426.9	101,760
8월물(mini)	337.74	1.75	5.80	35.0	19,214



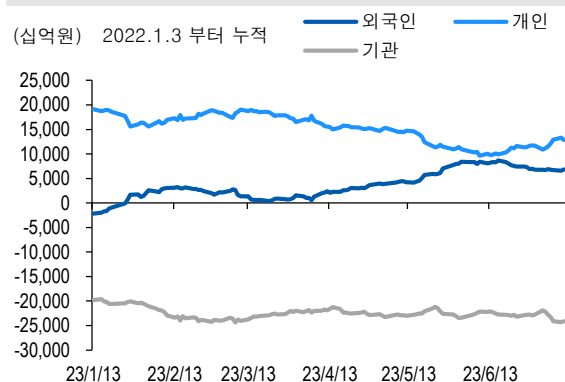
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	2.25	1.89	1.83	-0.11%
베이스(mini)	0.07	0.13	0.14	0.02%
제1스프레드(SP)	2.32	1.85	1.80	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.07	0.16	0.16	0.03%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	274.2	15.7	289.9	0.0	231.4	461.0	131.8	0.9	3.4	24.3
개인	-441.1	-13.6	-454.6	0.0	2.3	-551.1	-46.3	3.2	-4.5	-40.9
기관	164.7	21.0	185.7	-1.2	45.8	99.5	-86.9	-3.7	1.9	18.4
금융투자	80.8	39.5	120.3	0.0	2.3	-161.8	-81.9	-3.6	1.8	15.4
투신	18.5	-3.4	15.1	0.0	-3.5	205.9	2.6	-0.3	0.0	5.5
은행+보험+기타금융	20.9	-13.0	7.9	0.0	-1.7	52.3	-7.6	0.3	0.1	-0.2
연기금+국가자재	69.1	-2.1	67.0	0.0	51.8	3.1	0.0	-0.1	0.0	-2.2
기타법인	2.1	-3.3	-1.2	0.0	2.8	-9.4	1.4	-0.5	-0.8	-1.9

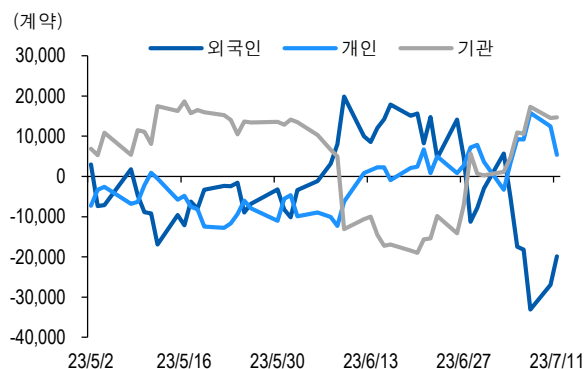
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	미결제약정
Call	1,576,526	348.1	1,333,993	13.1%	지수옵션 전체	3,232,332	580.7	3,138,508
Put	1,655,806	232.7	1,804,515	15.6%	PCR(금액기준)	0.67	VKOSPI	13.82%(-0.81%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	337.5(K+3)	1.39	1.22	441,244	32,075	-14,026	12.9	Put	332.5(K+1)	0.29	-2.41	388,024	42,209	14,026	13.9
	335.0(K+2)	2.94	2.42	278,634	25,159	-5,112	13.7		330.0(K+0)	0.13	-1.40	359,650	46,042	14,737	15.5
	332.5(K+1)	5.00	3.71	87,274	22,564	2,017	15.1		327.5(K-1)	0.07	-0.71	237,628	51,332	7,294	17.5
	330.0(K+0)	7.31	4.74	24,604	9,385	-58	16.9		325.0(K-2)	0.03	-0.32	157,040	41,420	416	18.6
	327.5(K-1)	9.58	5.25	1,673	2,298	-247	0.1		322.5(K-3)	0.02	-0.12	72,361	33,412	-11,915	20.9

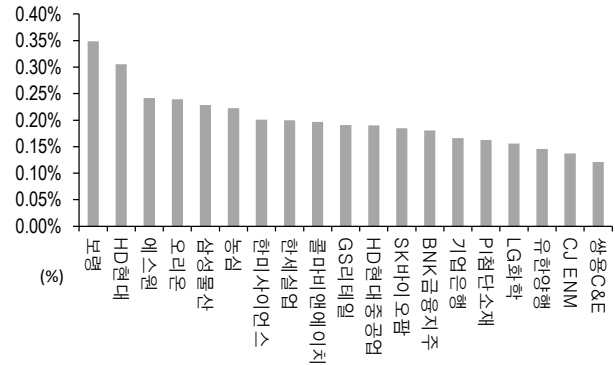
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	4,217,048	3,272.1	5,239,972	-35,888	53,257	-95,841	43,748	24.3	-40.9	18.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	113,000	2.36	176.4	71.3	138,543	-23,992	0.06%	6,189	-1,399	-4,777	-8,544	1,932
삼성전자	71,300	2.59	595.9	69.2	678,387	-285,688	-0.01%	-4,566	-16,848	25,573	33,461	-78
롯데에너지	53,200	2.50	12.6	65.8	22,182	-4,097	0.02%	109	1,035	-1,144	-614	-359
한국전력	19,660	0.82	14.2	64.4	71,810	-30,885	-0.10%	-18,944	-5,026	23,577	21,306	2,102
SK 이노베이션	164,800	0.98	43.7	60.2	15,785	-4,080	-0.03%	630	55	-654	-780	833
카카오페이	48,150	4.33	7.9	58.1	16,185	-2,180	0.01%	2,276	-302	-1,983	-5,720	-266
삼성 SDI	688,000	0.44	41.7	53.8	8,638	-1,789	0.04%	49	59	-108	-36	-116
포스코퓨처엠	396,500	-2.70	248.1	50.6	10,630	-4,359	0.05%	-3,529	1,291	2,208	2,182	349
LG 화학	655,000	0.31	60.6	48.5	5,778	-245	0.16%	-370	-27	397	-43	-281
현대차	206,500	0.49	53.7	48.4	29,656	-16,926	0.03%	658	451	-1,109	-743	-358

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터