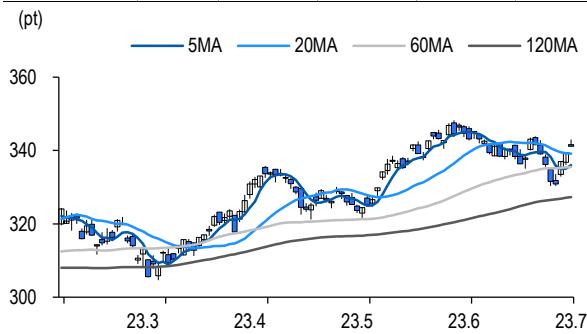


선물옵션시장 지표

2023.7.14

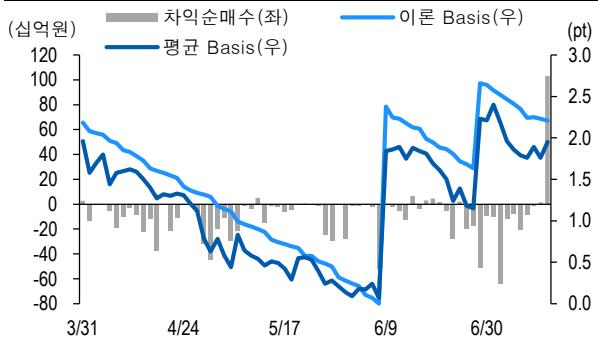
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	341.13	0.49	1.67	8,929.5	-
선물 9월물	343.65	0.84	2.85	19,279.3	289,657
선물 12월물	345.50	0.80	2.75	33.2	26,382
7월물(mini)	341.94	0.83	2.80	1,008.3	0
8월물(mini)	342.72	0.89	3.04	1,131.8	45,065



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.21	1.95	2.52	-0.08%
베이시스(mini)	0.00	0.09	0.81	0.03%
제1스프레드(SP)	2.37	1.83	1.85	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	0.78	0.78	0.23%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	208.3	15.1	223.3	0.0	288.6	1,294.6	-128.7	-8.9	0.7	18.1
개인	-719.1	-3.5	-722.6	0.0	4.4	-354.8	12.7	7.0	-2.7	15.2
기관	508.2	-6.7	501.5	103.0	-408.5	-702.2	117.5	0.4	2.1	-37.0
금융투자	349.3	32.6	382.0	103.0	-407.5	-1,046.3	120.3	1.0	1.9	2.0
투신	130.7	-10.0	120.7	0.0	11.0	295.3	-4.2	-1.2	0.1	-3.6
은행+보험+기타금융	3.8	-9.8	-6.0	0.0	-1.0	3.8	1.4	0.8	0.0	-0.3
연기금+국가지자체	-52.2	-32.2	-84.4	0.3	-42.4	44.9	0.0	-0.1	0.1	-35.1
기타법인	2.6	-0.7	1.9	0.0	0.3	-237.6	-1.5	1.5	0.0	3.7

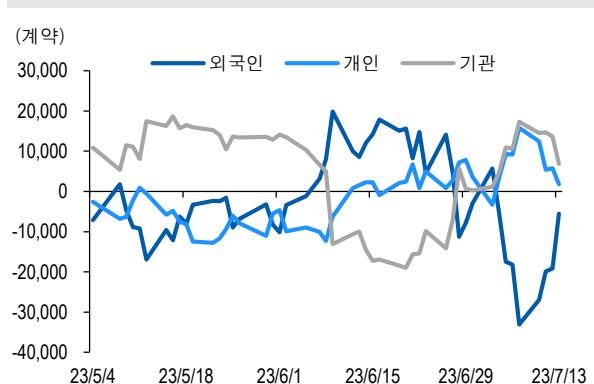
자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,886,268	310.7	675,087	10.9%	지수옵션 전체	3,667,918	529.6	1,678,118
Put	1,781,650	218.9	1,003,031	6.3%	PCR(금액기준)	0.70	VKOSPI	13.25%(-0.51%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	347.5(K+3)	0.01	0.00	119,976	0	-51,104	15.3	Put	342.5(K+1)	0.74	-2.67	569,358	0	-17,793	4.3
	345.0(K+2)	0.01	-0.02	522,851	0	-57,244	9.9		340.0(K+0)	0.01	-1.56	613,818	0	-33,772	3.7
	342.5(K+1)	0.16	-0.02	866,960	0	-58,267	8.5		337.5(K-1)	0.01	-0.52	177,451	0	-38,890	9.7
	340.0(K+0)	1.92	1.12	182,373	0	-44,402	17.6		335.0(K-2)	0.01	-0.12	74,031	0	-51,190	15.2
	337.5(K-1)	4.40	2.20	27,250	0	-28,879	29.2		332.5(K-3)	0.01	-0.04	52,768	0	-54,713	20.5

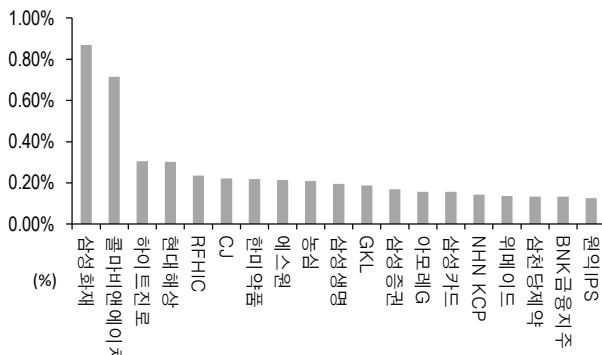
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)
주식선물 전체	5,057,921	4,104.5	3,983,994	-1,237,951	48,042	11,325	-65,475	18.1	15.2	-37.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	72,200	0.56	485.4	46.6	0	-407,200	-0.09%	-25,167	6,258	16,636
천보	186,700	-0.80	4.7	33.6	0	-4,199	-0.01%	85	37	-130
SK 하이닉스	114,300	-0.87	125.1	32.0	0	-116,719	-0.04%	3,863	8,061	-11,933
에코프로비엠	280,500	0.18	124.3	32.0	0	-31,553	-0.02%	802	3,324	-4,241
씨젠	21,050	2.93	4.3	31.3	0	-23,100	0.07%	-2,506	93	2,356
RFHIC	21,150	0.24	1.3	31.0	0	-9,602	0.24%	678	415	-1,093
메디톡스	232,500	-1.27	5.5	29.3	0	-3,194	0.07%	-52	-32	84
포스코퓨처엠	392,000	1.03	78.0	26.5	0	-8,435	0.01%	-90	-137	78
LG 전자	121,300	1.08	24.1	20.7	0	-27,220	-0.04%	1,192	-458	-736
카카오페이	50,700	3.15	5.0	20.0	0	-11,093	0.08%	-246	86	160

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터