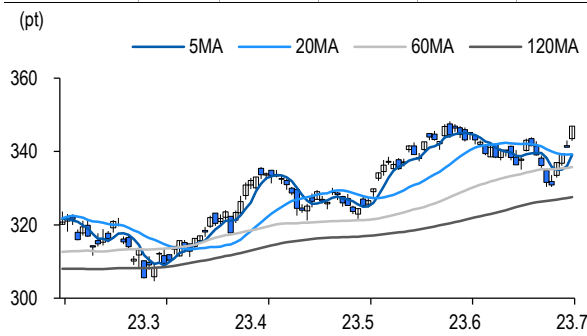


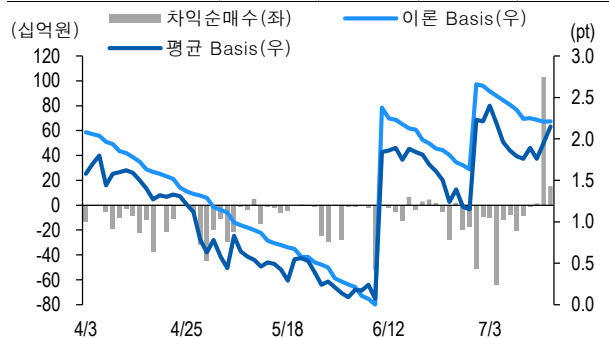
선물옵션시장 지표

2023.7.17

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	346.93	1.70	5.80	8,737.4	-
선물 9월물	348.20	1.32	4.55	20,444.2	289,726
선물 12월물	350.25	1.37	4.75	54.8	25,218
8월물(mini)	347.32	1.34	4.60	1,454.3	56,766
9월물(mini)	348.68	1.46	5.16	6.4	2,727



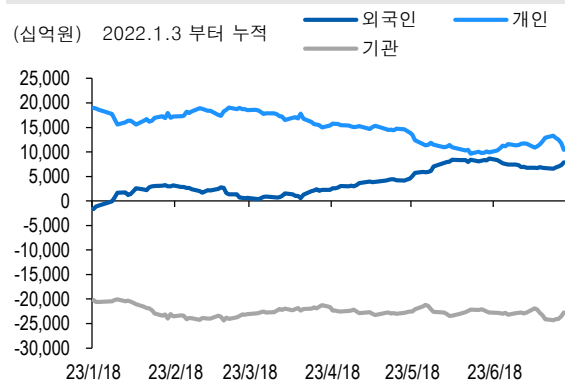
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	2.21	2.15	1.27	-0.02%
베이스(mini)	0.96	1.13	0.39	0.05%
제1스프레드(SP)	2.42	1.85	1.85	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	0.96	0.28	0.28	-0.20%



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

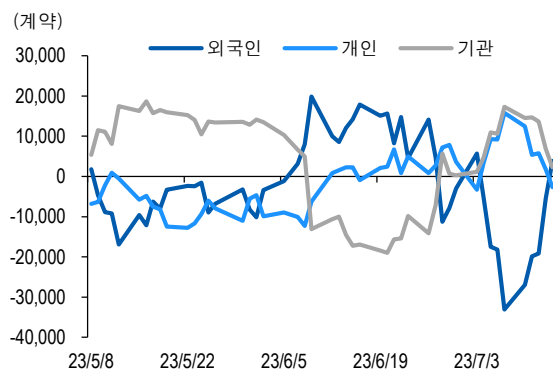
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	685,122	246.6	753,179	11.4%	지수옵션 전체	1,601,021	451.8	1,923,353
Put	915,899	205.2	1,170,174	13.4%	PCR(금액기준)	0.83	VKOSPI	13.19%(-0.06%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	347.5(K+3)	4.54	1.96	24,288	12,220	1,207	11.3	Put	342.5(K+1)	2.77	-1.80	24,562	8,878	4,544	13.2
	345.0(K+2)	6.12	2.61	24,892	14,527	7,183	11.8		340.0(K+0)	2.00	-1.50	60,227	12,535	5,333	13.2
	342.5(K+1)	7.49	2.80	5,788	6,903	577	11.2		337.5(K-1)	1.45	-1.21	72,522	9,753	6,183	13.3
	340.0(K+0)	9.21	3.06	2,217	6,900	355	10.8		335.0(K-2)	1.01	-0.95	89,910	16,759	9,507	13.4
	337.5(K-1)	11.35	3.55	583	3,243	-39	11.4		332.5(K-3)	0.70	-0.72	95,239	22,518	16,507	13.5

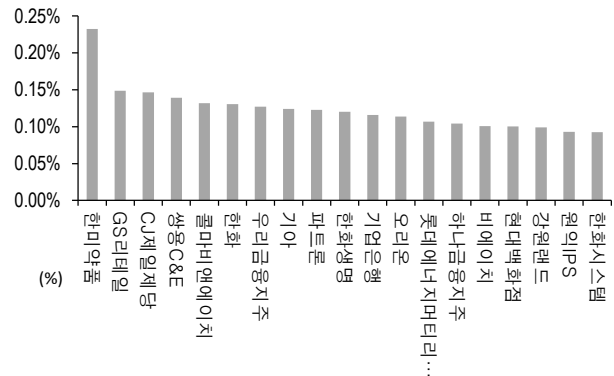
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 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	3,736,178	3,089.7	4,280,924	296,930	35,746	85,730	-126,888	0.5	65.4	-68.0		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK	149,500	1.36	18.3	89.2	10,299	3,125	0.00%	-759	2,125	-1,366	-1,360	-6
한올바이오파마	19,900	-0.45	3.0	88.4	4,023	38	-0.19%	-387	63	324	324	0
영진약품	2,440	-2.40	0.8	67.4	10,098	4,426	-0.08%	2,639	-369	-3,092	-3,092	0
웹젠	13,750	0.36	0.6	66.3	2,989	1,837	0.03%	-1,831	1,951	-121	-121	0
HD 한국조선해양	129,400	0.15	21.9	56.8	8,837	652	-0.20%	-905	-68	985	873	92
포스코퓨처엠	402,000	3.21	185.6	56.2	31,356	1,728	-0.11%	790	-1,133	351	656	45
엔씨소프트	295,500	0.85	12.2	54.8	5,068	414	-0.04%	-4	51	-47	168	-285
롯데에너지	54,500	1.87	8.7	53.4	35,985	1,935	0.11%	1,089	26	-1,136	-237	-901
한화에어로	135,600	-4.17	44.4	52.3	16,092	-24	-0.22%	-1,707	-1,143	2,861	2,392	469
RFHIC	21,000	0.72	2.3	51.8	24,508	1,769	-0.48%	161	30	-188	1,532	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터