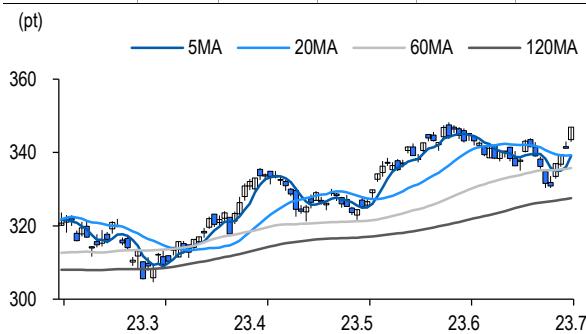


## 선물옵션시장 지표

2023.7.17

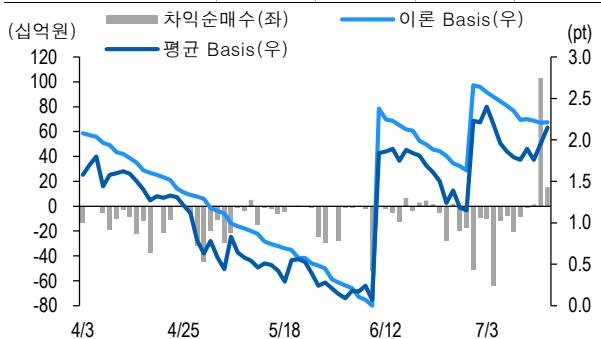
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(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	괴리율(%)
K200 베이시스	2.21	2.15	1.27	-0.02%
베이시스(mini)	0.96	1.13	0.39	0.05%
제1스프레드(SP)	2.42	1.85	1.85	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.96	0.28	0.28	-0.20%



## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

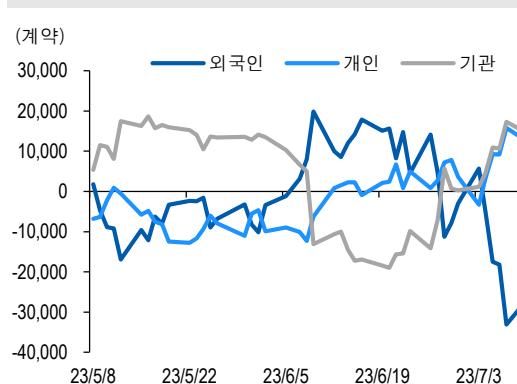
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	208.3	15.1	223.3	0.0	288.6	1,294.6	-128.7	-8.9	0.7	18.1
개인	-719.1	-3.5	-722.6	0.0	4.4	-354.8	12.7	7.0	-2.7	15.2
기관	508.2	-6.7	501.5	103.0	-408.5	-702.2	117.5	0.4	2.1	-37.0
금융투자	349.3	32.6	382.0	103.0	-407.5	-1,046.3	120.3	1.0	1.9	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



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	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								
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

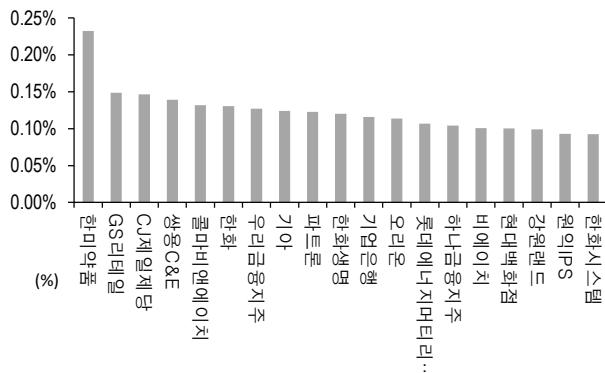
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	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(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK	149,500	1.36	18.3	89.2	10,299	3,125	0.00%	-759	2,125	-1,366
한울바이오파마	19,900	-0.45	3.0	88.4	4,023	38	-0.19%	-387	63	324
영진약품	2,440	-2.40	0.8	67.4	10,098	4,426	-0.08%	2,639	-369	-3,092
웹젠	13,750	0.36	0.6	66.3	2,989	1,837	0.03%	-1,831	1,951	-121
HD 한국조선해양	129,400	0.15	21.9	56.8	8,837	652	-0.20%	-905	-68	985
포스코퓨처엠	402,000	3.21	185.6	56.2	31,356	1,728	-0.11%	790	-1,133	351
엔씨소프트	295,500	0.85	12.2	54.8	5,068	414	-0.04%	-4	51	-47
롯데에너지	54,500	1.87	8.7	53.4	35,985	1,935	0.11%	1,089	26	-1,136
한화에어로	135,600	-4.17	44.4	52.3	16,092	-24	-0.22%	-1,707	-1,143	2,861
RFHIC	21,000	0.72	2.3	51.8	24,508	1,769	-0.48%	161	30	-188

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터