

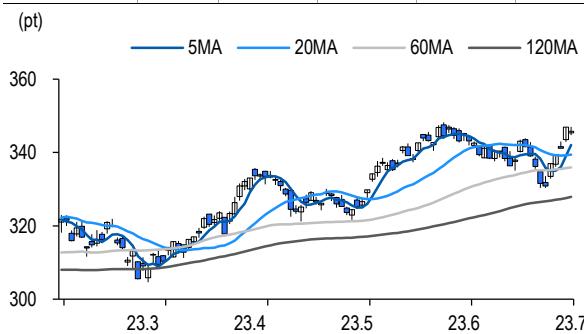


## 선물옵션시장 지표

2023.7.18

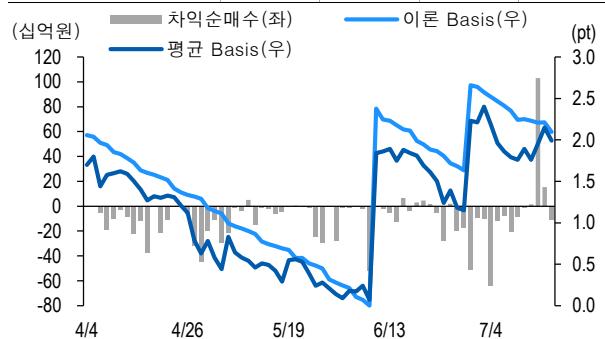
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	345.75	-0.34	-1.18	7,892.1	-
선물 9월물	347.90	-0.09	-0.30	14,923.9	286,854
선물 12월물	349.80	-0.13	-0.45	38.5	25,039
8월물(mini)	346.88	-0.13	-0.44	974.8	54,870
9월물(mini)	347.80	-0.11	-0.88	4.7	2,737



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.10	1.99	2.15	-0.03%
베이시스(mini)	0.85	0.94	1.13	0.03%
제1스프레드(SP)	2.41	1.85	1.90	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.85	1.09	1.09	0.07%



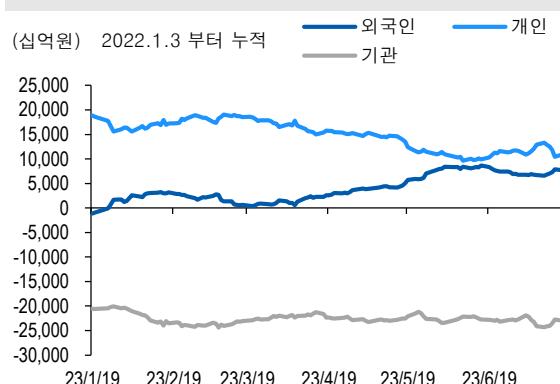
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-200.5	-0.8	-201.3	0.0	-168.3	143.0	11.8	-1.9	0.9	-26.5
개인	425.8	49.6	475.4	0.0	-7.0	70.3	14.3	0.1	-1.3	20.7
기관	-231.2	-71.6	-302.7	-11.2	-98.3	-195.5	-26.3	1.3	1.3	4.9
금융투자	5.8	-104.8	-99.0	-9.4	0.0	151.6	-15.9	1.5	1.4	6.0
투신	-58.3	18.5	-39.9	0.0	-38.4	-327.8	-9.9	-0.2	0.0	2.6
은행+보험+기타금융	-21.5	5.1	-16.4	0.0	-7.3	-22.5	-0.6	0.0	-0.1	0.7
연기금+국가지자체	-132.5	10.6	-121.9	0.0	-42.0	3.1	0.0	0.0	0.0	-4.5
기타법인	5.9	1.3	7.2	0.0	-2.9	-17.8	0.2	0.6	-0.9	0.9

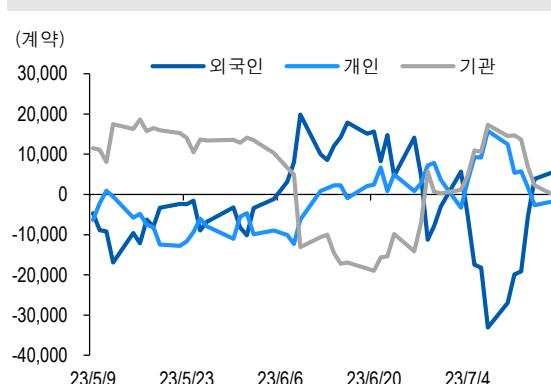
자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



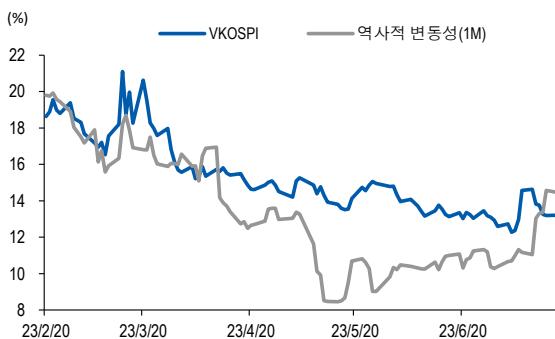
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	531,352	145.7	795,537	12.0%	지수옵션 전체	1,063,137	296.6	2,013,264						
Put	531,785	150.9	1,217,727	12.3%	PCR(금액기준)	1.04	VKOSPI	13.21% (+0.02%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
Call	355.0(K+3)	1.42	-0.36	68,020	17,411	1,770	12.0	350.0(K+1)	6.11	-0.02	2,187	2,330	405	11.6
	352.5(K+2)	2.07	-0.39	46,423	18,154	1,715	12.1	347.5(K+0)	4.72	-0.09	6,595	4,319	896	11.8
Put	350.0(K+1)	2.94	-0.51	33,998	19,742	2,256	12.2	345.0(K-1)	3.56	-0.14	19,584	6,635	876	12.0
	347.5(K+0)	4.06	-0.48	14,262	12,412	192	12.4	342.5(K-2)	2.62	-0.15	37,593	10,022	1,144	12.2
	345.0(K-1)	5.36	-0.76	6,408	14,225	-302	12.5	340.0(K-3)	1.89	-0.11	53,850	14,219	1,684	12.4

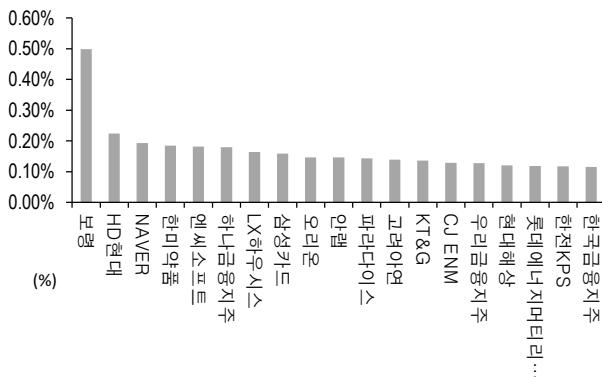
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	3,277,180	2,913.7	4,684,837	403,913	-26,948	38,575	-14,504	-26.5	20.7	4.9
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	73,500	0.00	544.1	73.9	1,088,394	4,978	0.00%	-5,753	-4,649	10,278
SK	148,500	-0.67	9.7	63.4	10,340	41	0.00%	506	-13	-493
SK 하이닉스	117,600	-0.34	176.3	62.5	209,093	8,580	0.03%	-1,046	2,259	-1,204
에스엠	117,500	-0.68	20.2	59.7	31,710	878	0.01%	-191	946	-754
호텔신라	75,700	0.40	10.2	59.2	9,216	-159	-0.03%	-409	324	85
DL 이앤씨	32,500	2.20	3.3	58.2	8,248	1,309	-0.02%	-767	1,739	-972
영진약품	2,440	0.00	0.5	57.2	12,012	1,914	-0.45%	-24	572	-551
한울바이오파마	20,450	2.76	3.3	56.6	4,061	38	-0.21%	-1,329	228	1,101
RFHIC	21,400	1.90	1.9	55.7	24,381	-127	-0.22%	1,287	444	-1,731
한화에어로	131,700	-2.88	41.4	54.6	17,677	1,585	-0.03%	930	781	-1,736

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터