

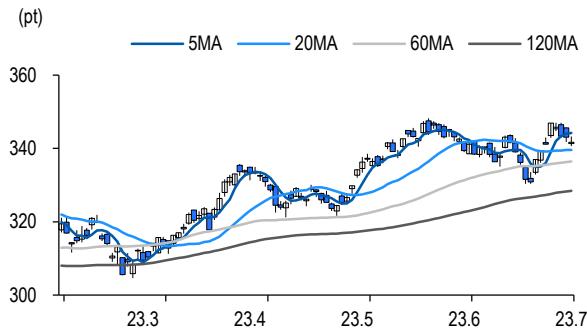


선물옵션시장 지표

2023.7.21

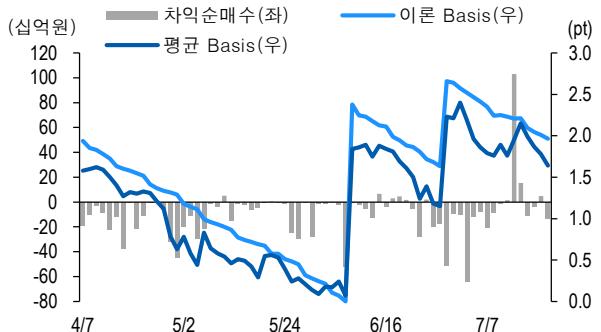
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	341.67	-0.42	-1.44	6,797.0	-
선물 9월물	343.30	-0.32	-1.10	15,979.4	286,496
선물 12월물	345.25	-0.35	-1.20	21.8	25,499
8월물(mini)	342.30	-0.34	-1.18	1,416.2	55,110
9월물(mini)	343.42	-0.28	-1.26	3.4	2,804



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.97	1.64	1.63	-0.10%
베이시스(mini)	0.74	0.65	0.63	-0.03%
제1스프레드(SP)	2.37	1.85	1.90	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.74	0.64	0.64	-0.03%



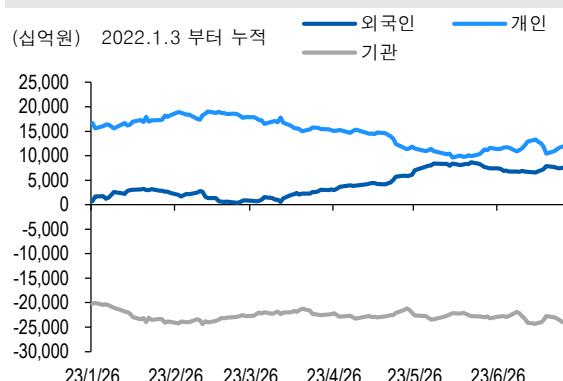
투자주체별 매매 동향

(십억원)

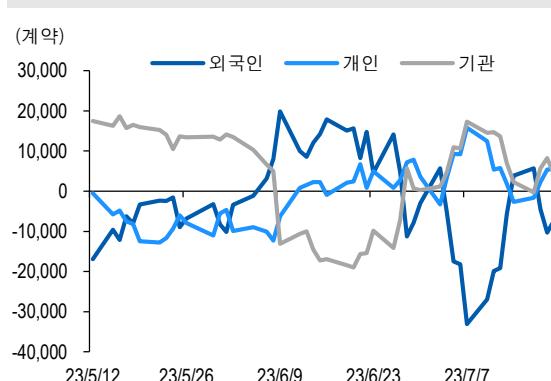
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	145.7	-3.7	141.9	0.0	192.7	212.9	38.9	-0.2	-4.9	10.7
개인	150.2	40.5	190.8	0.0	-13.8	27.1	-5.1	0.0	3.4	26.6
기관	-316.2	-72.0	-388.2	-13.1	70.4	-312.9	-33.9	0.5	0.5	-38.5
금융투자	-270.9	-102.8	-373.7	-10.6	9.2	-137.1	-26.2	0.5	0.5	-42.2
투신	-19.7	18.9	-0.8	0.0	-6.4	-184.4	-7.1	0.0	0.0	4.4
은행+보험+기타금융	-20.4	0.6	-19.7	0.0	-10.1	-19.3	-0.7	0.0	0.0	-0.2
연기금+국가지자체	44.3	11.2	55.5	0.0	78.5	27.8	0.0	0.0	0.0	-0.5
기타법인	20.3	-9.7	10.6	0.0	-0.4	73.0	0.1	-0.2	1.0	1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

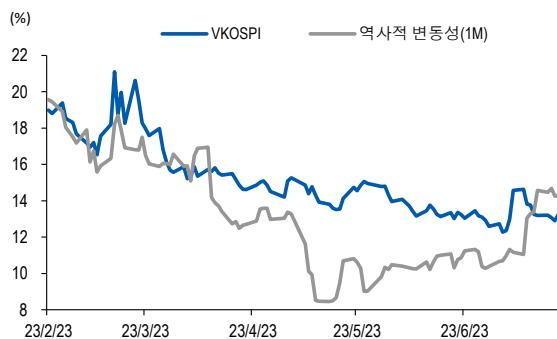
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	641,100	172.6	868,076	11.5%	지수옵션 전체	1,239,827	333.7	2,195,958							
Put	598,727	161.1	1,327,882	12.4%	PCR(금액기준)	0.93	VKOSPI	13.22%(+0.31%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	350.0(K+3)	1.23	-0.34	120,052	29,745	3,510	11.5	Put	345.0(K+1)	5.42	0.68	7,183	7,693	408	12.0
	347.5(K+2)	1.87	-0.47	65,253	16,291	2,010	11.5		342.5(K+0)	4.07	0.58	16,624	11,572	56	12.1
	345.0(K+1)	2.76	-0.62	39,144	15,210	1,850	11.6		340.0(K-1)	2.95	0.45	34,713	18,571	2,426	12.2
	342.5(K+0)	3.88	-0.69	12,309	9,113	1,612	11.7		337.5(K-2)	2.11	0.33	52,022	16,452	1,617	12.4
	340.0(K-1)	5.27	-0.72	4,415	8,129	1,063	11.8		335.0(K-3)	1.46	0.28	79,429	16,736	-93	12.6

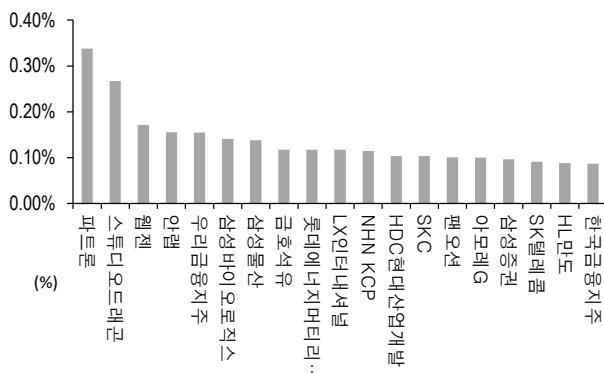
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,187,208	3,297.2	4,877,598	107,833	128,594	25,209	-155,615	10.7	26.6	-38.5
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
영진약품	2,495	0.81	0.9	98.1	17,081	2,693	0.04%	3,739	390	-4,137
삼성전자	71,300	-0.83	519.0	75.0	1,145,645	23,770	0.05%	10,469	13,566	-24,359
넥센타이어	8,380	-0.48	0.6	74.0	4,701	1,175	0.06%	2,032	57	-2,095
삼성전기	153,600	0.00	27.3	65.2	19,409	566	0.07%	432	452	-884
에스엠	122,600	3.63	22.8	62.1	35,573	3,655	-0.01%	-1,036	4,172	-3,136
SK 하이닉스	116,900	-0.68	136.4	61.9	220,948	887	0.01%	3,725	560	-4,753
현대제철	33,500	0.15	7.1	61.5	13,165	3,563	0.00%	2,741	654	-3,396
POSCO 흘딩스	499,500	0.00	377.6	57.4	27,964	-219	-0.02%	-634	8	623
현대건설	37,350	-0.66	12.7	57.0	18,607	-1,488	0.00%	3,956	11	-3,967
포스코퓨처엠	466,000	-3.12	353.9	52.3	29,049	501	-0.05%	-1,107	58	1,017

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터