

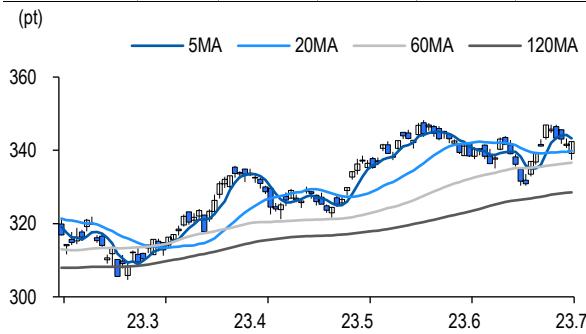


선물옵션시장 지표

2023.7.24

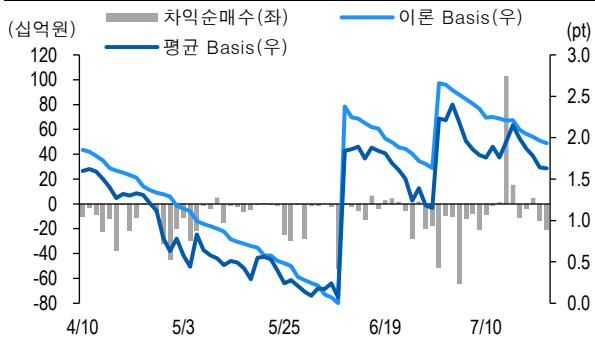
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	342.39	0.21	0.72	9,718.5	-
선물 9월물	344.15	0.25	0.85	18,555.5	285,923
선물 12월물	345.90	0.19	0.65	37.2	25,449
8월물(mini)	343.12	0.24	0.82	1,263.1	55,055
9월물(mini)	344.04	0.22	0.62	7.4	3,002



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.93	1.63	1.76	-0.09%
베이시스(mini)	0.70	0.64	0.73	-0.02%
제1스프레드(SP)	2.38	1.90	1.90	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.70	0.72	0.72	0.00%



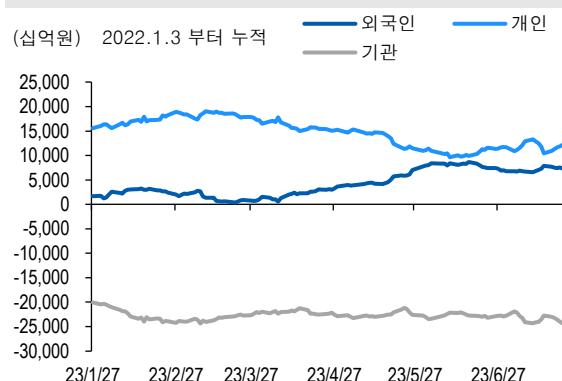
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-311.1	26.4	-284.7	0.0	34.9	-30.9	39.6	0.5	0.0	-5.5
개인	314.4	-9.4	305.0	0.0	-4.8	-82.1	-15.5	-1.2	0.8	13.2
기관	4.8	-45.4	-40.6	-20.5	-7.5	-42.4	-22.7	1.2	-1.6	-6.4
금융투자	17.5	-154.4	-136.9	-18.8	3.9	38.6	-26.0	1.3	-1.5	-19.7
투신	-7.8	5.6	-2.2	0.0	-9.7	-95.5	3.9	0.0	0.0	3.7
은행+보험+기타금융	-14.4	6.9	-7.5	0.0	-2.6	30.7	-0.6	-0.1	-0.1	0.7
연기금+국가지자체	-7.7	88.6	80.9	0.0	5.4	-16.2	0.0	0.0	0.0	8.9
기타법인	-8.1	8.2	0.1	0.0	3.9	155.4	-1.4	-0.5	0.9	-1.3

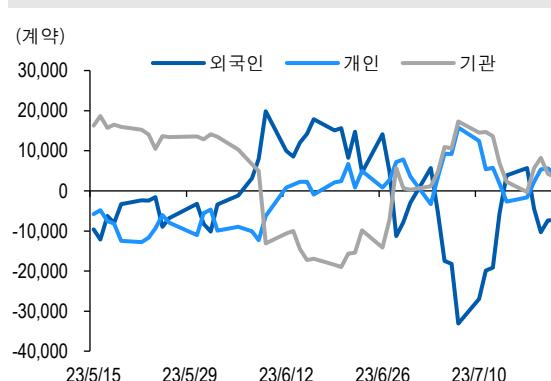
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



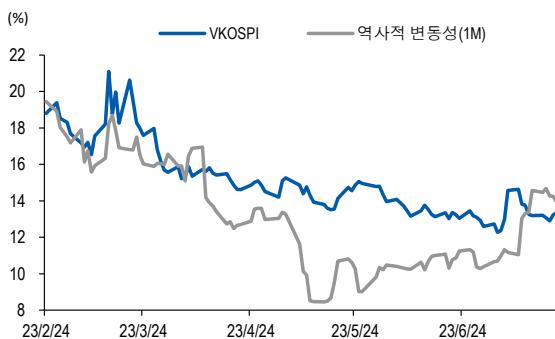
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	853,774	205.5	893,458	11.6%	지수옵션 전체	1,689,356	416.6	2,268,827
Put	835,582	211.1	1,375,369	12.7%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	13.35%(+0.13%p)
<hr/>								
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	350.0(K+3)	1.33	0.10	131,241	30,895	1,150	11.5	Put
	347.5(K+2)	2.05	0.18	116,305	19,438	3,147	11.7	345.0(K+1)
	345.0(K+1)	3.00	0.24	77,561	17,430	2,220	11.8	342.5(K+0)
	342.5(K+0)	4.28	0.40	42,829	11,658	2,545	12.1	340.0(K-1)
	340.0(K-1)	5.71	0.44	21,231	10,371	2,242	12.1	337.5(K-2)
	<hr/>							
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	345.0(K+1)	4.89	-0.53	2,517	7,757	64	11.8	335.0(K-3)
	342.5(K+0)	3.67	-0.40	9,557	11,289	-283	12.1	330.0(K-2)
	340.0(K-1)	2.61	-0.34	25,384	18,123	-448	12.2	327.5(K-1)
	327.5(K-2)	1.87	-0.24	41,014	16,486	34	12.6	325.0(K-3)
	325.0(K-3)	1.29	-0.17	68,129	18,394	1,658	12.8	322.5(K-4)

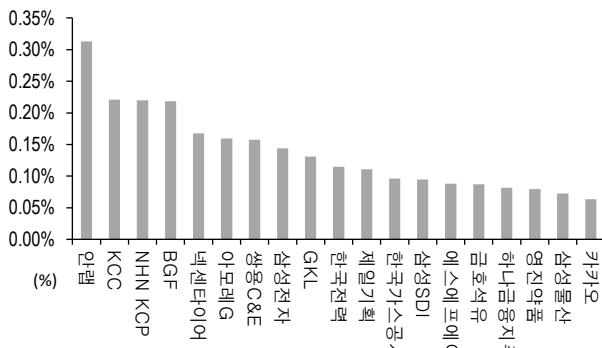
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,567,376	4,180.7	4,935,360	57,762	-48,518	40,503	8,156	-5.5	13.2	-6.4	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	
넥센타이어	8,360	-0.24	0.5	73.2	5,061	360	0.17%	909	-29	-881	-881
롯데케미칼	148,300	-0.67	6.7	65.7	2,864	-66	-0.03%	-348	126	222	45
삼성전자	70,600	-0.98	758.2	65.7	1,175,017	29,372	0.14%	1,337	21,096	-24,697	-28,954
LG 화학	692,000	0.87	98.2	61.9	8,050	923	-0.01%	602	354	-1,036	-796
SK 이노베이션	176,800	1.96	83.2	60.7	22,993	392	-0.26%	794	-932	140	37
SK	148,200	-0.40	12.0	60.6	11,185	75	0.01%	-339	-202	541	559
현대건설	37,900	1.47	19.6	55.8	20,065	1,458	-0.01%	-5,226	2,539	2,686	2,241
포스코퓨처엠	491,000	5.36	552.5	55.7	28,952	-97	-0.07%	-1,308	-1,057	2,315	1,845
아모레퍼시픽	103,200	0.78	9.7	51.9	7,591	580	0.00%	632	186	-818	-642
LG 전자	121,300	-0.33	27.6	51.3	46,217	-1,158	0.02%	2,533	13	-1,058	357

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터