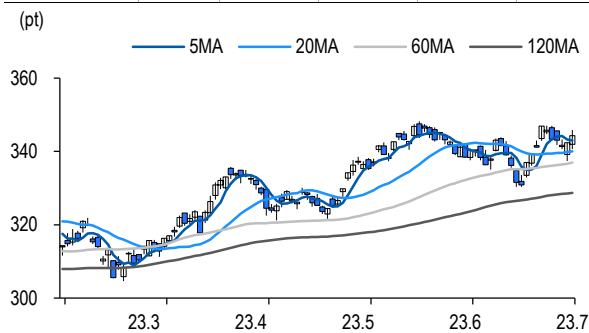


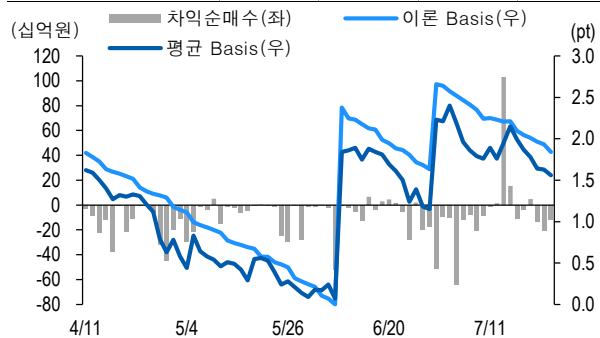
선물옵션시장 지표

2023.7.25

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	344.32	0.56	1.93	14,675.7	-
선물 9월물	346.00	0.54	1.85	22,107.6	283,698
선물 12월물	347.85	0.56	1.95	63.0	25,479
8월물(mini)	345.00	0.55	1.88	1,192.8	54,133
9월물(mini)	346.02	0.54	1.98	6.5	3,015



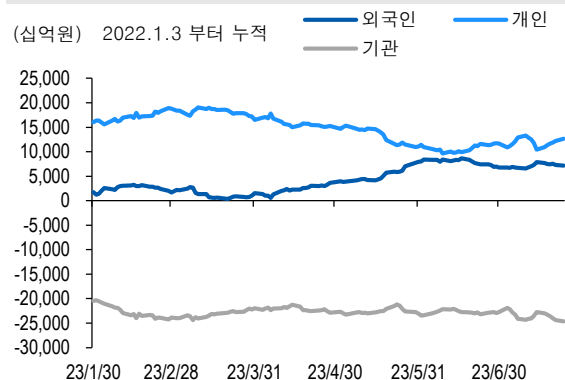
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.84	1.56	1.68	-0.08%
베이스스(mini)	0.60	0.56	0.68	-0.01%
제1스프레드(SP)	2.40	1.89	1.90	-0.15%
합성선물 베이스스(ATM)	0.60	0.66	0.66	0.02%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-170.4	38.1	-132.3	0.0	-56.6	-50.1	12.8	-6.9	-1.6	-3.2
개인	469.7	-16.0	453.7	0.0	10.2	68.0	3.9	8.1	0.8	-46.8
기관	-303.2	29.9	-273.4	-11.9	-31.5	-57.9	-16.6	-1.3	1.0	45.6
금융투자	-221.9	59.0	-163.0	-8.6	-8.0	-363.8	-16.5	-1.0	1.0	71.9
투신	1.9	28.6	30.5	0.0	-7.5	302.7	-0.6	-0.3	0.0	-25.3
은행+보험+기타금융	-11.7	-68.4	-80.1	0.0	-2.9	4.9	0.5	0.0	0.0	-0.1
연기금+국가자재	-37.2	7.9	-29.4	0.0	-6.7	-1.7	0.0	0.0	0.0	-1.0
기타법인	3.9	-2.9	1.0	0.0	-4.1	39.9	0.0	0.0	-0.2	4.5

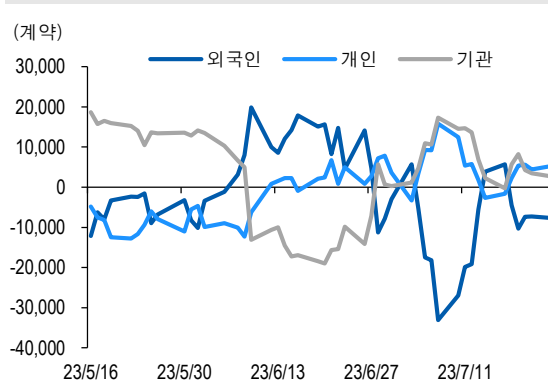
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



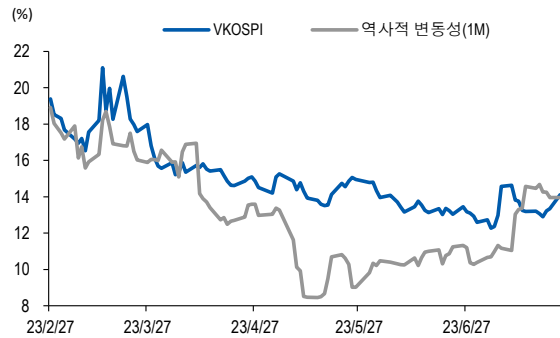
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	890,418	267.3	906,767	12.7%	지수옵션 전체	1,737,871	483.0	2,307,207			
Put	847,453	215.7	1,400,440	13.5%	PCR(금액기준)	0.81	VKOSPI	14.12%(+0.77%p)			

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	350.0(K+3)	1.89	0.56	143,034	33,485	2,590	12.7	Put	345.0(K+1)	3.94	-0.95	15,940	7,640	-117	12.8
	347.5(K+2)	2.77	0.72	78,428	20,439	1,001	12.8		342.5(K+0)	2.85	-0.82	37,363	11,941	652	13.0
	345.0(K+1)	3.91	0.91	48,744	17,584	154	12.9		340.0(K-1)	2.01	-0.60	66,123	20,682	2,559	13.2
	342.5(K+0)	5.33	1.05	20,029	13,632	1,974	13.1		337.5(K-2)	1.40	-0.47	98,237	18,105	1,619	13.5
	340.0(K-1)	6.98	1.27	5,072	11,153	782	13.3		335.0(K-3)	0.92	-0.37	127,766	21,383	2,989	13.7

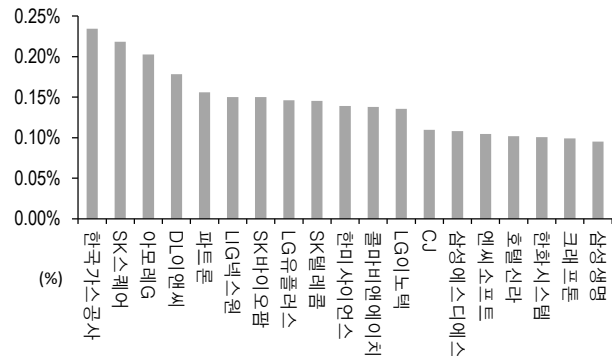
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,244,749	5,876.2	4,988,322	52,962	49,689	-2,182	-49,233	-3.2	-46.8	45.6		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대백화점	54,400	-1.45	3.8	73.0	2,369	-1,657	-0.13%	1,147	-1,605	458	458	0
HD 한국조선해양	126,600	0.80	28.5	69.5	10,652	315	-0.01%	113	499	-612	-420	-201
영원무역	58,400	1.57	3.3	67.1	3,067	-288	-0.18%	-622	60	562	564	0
영진약품	2,400	-4.57	1.0	62.9	15,680	-1,458	0.00%	3,822	-1,837	-1,978	-1,978	0
SK 하이닉스	114,200	-1.04	195.9	62.3	226,418	4,386	0.04%	2,918	3,681	-6,649	-8,321	1,586
삼성전자	70,500	-0.14	577.3	61.4	1,175,502	485	-0.01%	-3,094	5,850	-2,865	-2,003	-310
넥센타이어	8,310	-0.60	0.4	61.0	4,318	-743	0.00%	-469	-97	567	567	0
에스엠	116,500	-1.69	12.6	56.4	32,477	-2,580	-0.05%	1,101	-2,647	1,546	1,546	0
KB 금융	47,700	-2.15	20.5	55.8	26,109	2,157	0.03%	664	748	-1,412	-1,796	384
삼성전기	150,500	0.33	28.4	55.4	19,348	200	0.08%	-226	500	-274	-457	282

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터