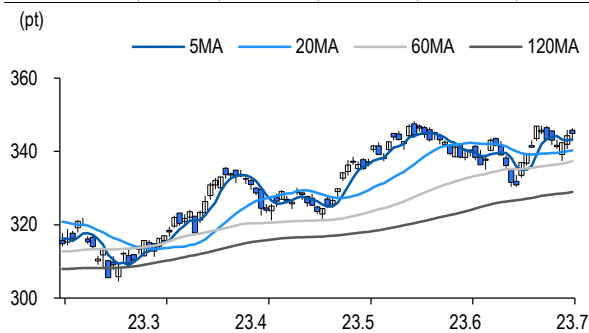


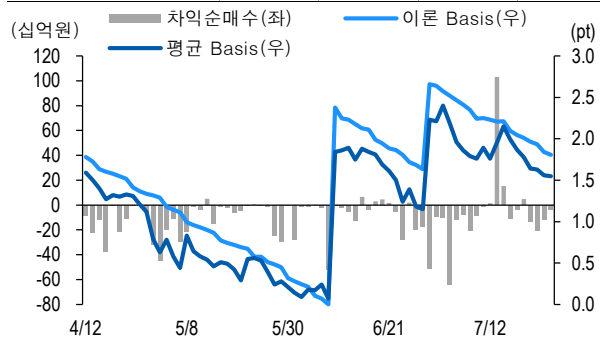
선물옵션시장 지표

2023.7.26

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	344.92	0.17	0.60	14,803.5	-
선물 9월물	346.40	0.12	0.40	15,066.2	282,742
선물 12월물	348.25	0.11	0.40	30.8	25,453
8월물(mini)	345.40	0.12	0.40	983.6	55,130
9월물(mini)	346.34	0.10	0.32	8.2	3,050



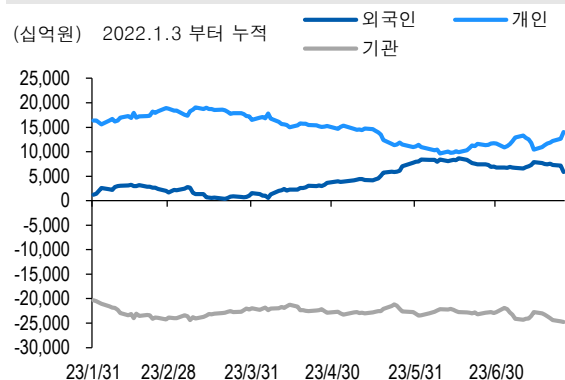
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.81	1.55	1.48	-0.07%
베이스스(mini)	0.57	0.55	0.48	0.00%
제1스프레드(SP)	2.41	1.90	1.90	-0.15%
합성선물 베이스스(ATM)	0.57	0.49	0.49	-0.02%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-1,360.2	76.8	-1,283.4	0.0	-262.2	-260.1	24.8	-1.3	-1.5	-15.6
개인	1,373.7	-5.3	1,368.4	0.0	5.0	35.0	10.6	1.2	1.0	59.9
기관	-69.0	-71.7	-140.7	-3.9	-73.3	207.2	-35.7	-0.1	0.6	-49.2
금융투자	43.8	-18.9	24.9	-3.6	1.7	311.1	-37.4	0.0	0.6	-70.4
투신	-99.7	18.6	-81.1	0.0	-57.7	-126.8	1.0	-0.1	0.0	20.2
은행+보험+기타금융	-24.0	-73.1	-97.1	-0.3	-2.6	27.5	0.7	0.0	0.0	0.2
연기금+국가지자체	-39.1	2.2	-36.9	0.0	-8.4	-4.7	0.0	0.0	0.0	0.7
기타법인	55.5	-1.4	54.1	0.0	4.3	17.9	0.3	0.1	-0.1	5.0

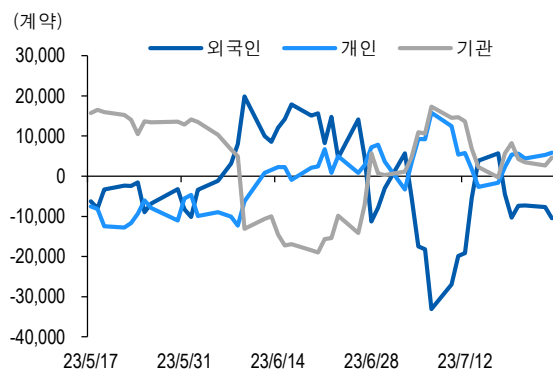
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



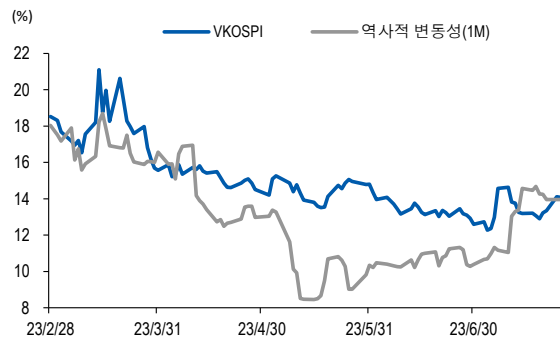
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	533,222	146.4	918,963	12.3%	지수옵션 전체	1,111,610	299.8	2,342,601
Put	578,388	153.4	1,423,638	13.5%	PCR(금액기준)	1.05	VKOSPI	14.08%(-0.04%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	352.5(K+3)	1.19	-0.03	86,272	27,114	702	12.2	Put	347.5(K+1)	4.91	-0.36	4,763	4,825	218	12.9
	350.0(K+2)	1.88	-0.01	73,361	34,219	734	12.4		345.0(K+0)	3.60	-0.34	18,750	8,107	467	13.0
	347.5(K+1)	2.78	0.01	40,543	20,810	371	12.4		342.5(K-1)	2.59	-0.26	31,778	14,467	2,526	13.2
	345.0(K+0)	4.01	0.10	15,973	18,630	1,046	12.6		340.0(K-2)	1.79	-0.22	63,945	21,152	470	13.4
	342.5(K-1)	5.46	0.13	5,616	13,937	305	12.7		337.5(K-3)	1.22	-0.18	73,363	19,818	1,713	13.7

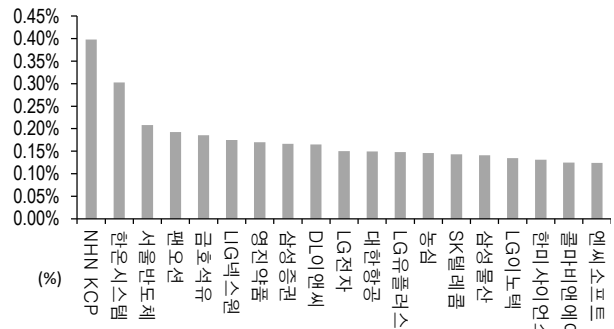
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,916,221	5,041.0	5,015,782	27,460	27,332	32,424	-60,454	-15.6	59.9	-49.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	8,420	1.32	0.9	96.4	3,417	-901	-0.04%	-604	-24	628	628	0
영진약품	2,355	-1.88	1.0	80.5	11,918	-3,762	0.17%	-536	1	528	528	0
삼성전기	149,000	-1.00	27.8	58.7	18,398	-950	0.06%	-731	-825	1,560	872	688
한올바이오파마	22,350	-1.54	3.7	56.5	11,421	229	-0.17%	871	-239	-632	-632	0
삼성전자	70,300	-0.28	521.2	55.2	1,160,246	-15,256	-0.02%	-11,714	-2,085	11,351	13,161	-1,370
HD 한국조선해양	127,400	0.63	21.0	55.0	10,526	-126	-0.05%	-400	-94	494	177	319
롯데케미칼	147,100	-0.68	6.6	52.4	3,887	360	-0.01%	-569	145	381	257	126
영원무역	57,800	-1.03	1.8	49.8	3,177	110	0.10%	325	-5	-320	-320	0
한국전력	19,410	-0.56	9.4	49.7	77,377	1,229	0.10%	-1,999	2,838	-839	1,128	-1,954
SK 하이닉스	113,700	-0.44	141.0	46.8	234,712	8,294	0.05%	5,866	3,421	-11,260	-14,026	863

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터