

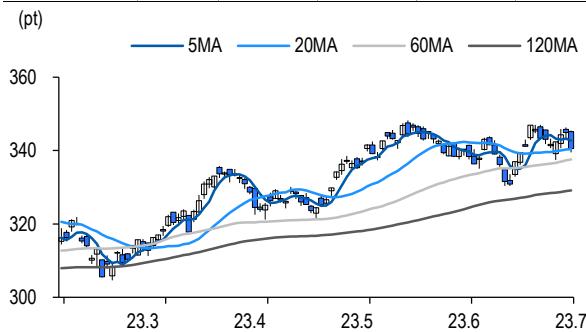


선물옵션시장 지표

2023.7.27

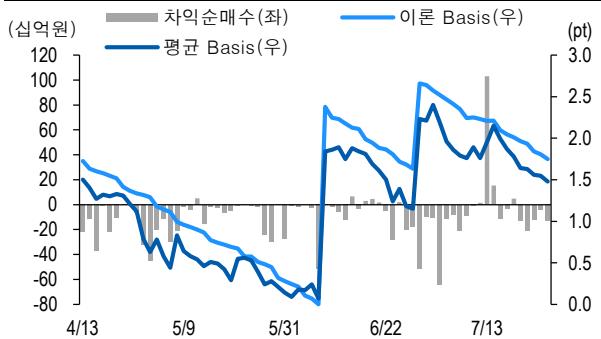
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	340.56	-1.26	-4.36	30,262.9	-
선물 9월물	342.45	-1.14	-3.95	27,301.7	283,379
선물 12월물	344.35	-1.12	-3.90	39.0	25,268
8월물(mini)	341.40	-1.16	-4.00	1,675.4	56,807
9월물(mini)	342.46	-1.14	-3.88	8.6	3,222



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.75	1.48	1.89	-0.08%
베이시스(mini)	0.52	0.48	0.84	-0.01%
제1스프레드(SP)	2.37	1.95	1.90	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	0.52	0.83	0.83	0.09%



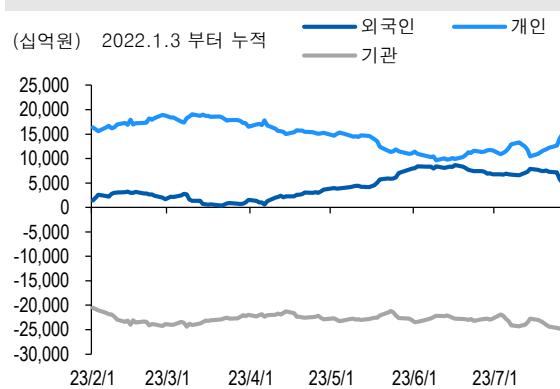
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-946.5	58.7	-887.8	0.0	-384.6	-346.1	-8.2	4.8	0.5	-7.4
개인	994.3	14.2	1,008.5	0.0	3.2	195.3	28.6	-4.2	-0.7	47.5
기관	-66.1	-69.2	-135.3	-13.1	-82.1	98.5	-21.2	-0.2	0.2	-39.5
금융투자	247.9	-62.2	185.7	-14.6	0.3	281.5	-19.9	0.1	0.2	-33.6
투신	-131.6	-0.5	-132.1	0.0	-70.6	-157.5	0.6	-0.1	0.0	-15.8
은행+보험+기타금융	-32.5	-47.8	-80.3	0.0	-3.8	-12.9	-1.9	-0.2	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-18.0	17.1	-1.0	0.0	28.8	-12.7	0.0	0.0	0.0	9.9
기타법인	18.3	20.2	38.5	0.0	-3.6	52.3	0.7	-0.3	0.0	-0.6

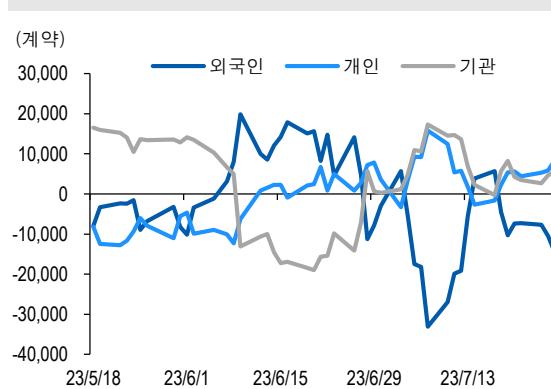
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,065,836	262.1	950,043	13.1%	지수옵션 전체		2,125,007	569.8	2,408,750
Put	1,059,171	307.7	1,458,707	13.2%	PCR(금액기준)		1.17	VKOSPI	14.53% (+0.45%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	352.5(K+3)	0.52	-0.67	174,825	30,301	3,187	13.0	347.5(K+1)	7.52
	350.0(K+2)	0.88	-1.00	197,137	34,123	-96	13.1	345.0(K+0)	5.80
	347.5(K+1)	1.43	-1.35	121,259	24,336	3,526	13.2	342.5(K-1)	4.35
	345.0(K+0)	2.19	-1.82	57,091	18,724	94	13.3	340.0(K-2)	3.15
	342.5(K-1)	3.22	-2.24	29,158	15,520	1,583	13.6	337.5(K-3)	2.23
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	347.5(K+1)	7.52	2.61	3,765	4,781	-44	12.0	345.0(K+0)	5.80
	345.0(K+0)	5.80	2.20	20,608	8,146	39	12.3	342.5(K-1)	4.35
	342.5(K-1)	4.35	1.76	46,468	15,001	534	12.7	340.0(K-2)	3.15
	340.0(K-2)	3.15	1.36	78,747	21,412	260	13.0	337.5(K-3)	2.23
	337.5(K-3)	2.23	1.01	121,414	21,730	1,912	13.3	337.5(K-3)	2.23

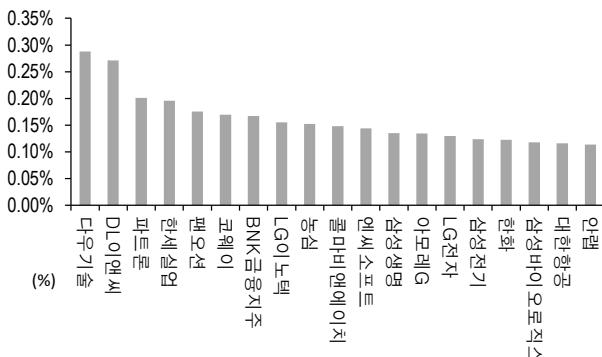
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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	7,807,052	12,274.7	4,990,897	-24,885	-63,703	73,754	-9,927	-7.4	47.5	-39.5
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
넥센타이어	8,170	-2.97	1.2	90.4	3,257	-160	-0.16%	-272	12	265
영진약품	2,200	-6.58	2.1	73.9	5,668	-6,250	-0.09%	-2,615	-77	2,700
DL 이앤씨	30,200	-2.74	6.9	65.6	15,185	4,732	0.27%	-4,062	7,084	-3,022
삼성전자	69,700	-0.85	1,314.8	63.8	1,161,966	1,720	0.03%	-6,009	20,232	-16,751
HD 한국조선해양	125,800	-1.26	40.3	62.6	9,003	-1,523	0.00%	-3,233	4,694	-1,479
한울바이오파마	21,800	-2.46	5.5	56.2	12,270	849	-0.11%	361	-772	411
SK 하이닉스	113,300	-0.35	310.0	54.8	230,213	-4,499	-0.01%	-1,930	1,879	-1,152
LG 화학	734,000	0.82	479.7	52.7	9,210	627	0.03%	-344	404	-245
롯데케미칼	143,700	-2.31	12.5	49.5	3,456	-431	0.04%	844	-78	-766
삼성전기	144,200	-3.22	37.9	49.1	18,969	571	0.12%	1,608	387	-1,999

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터