

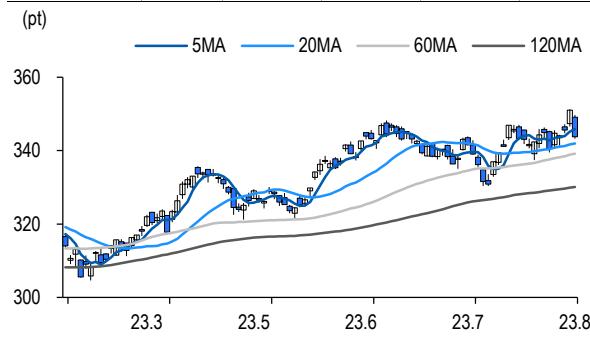


선물옵션시장 지표

2023.8.3

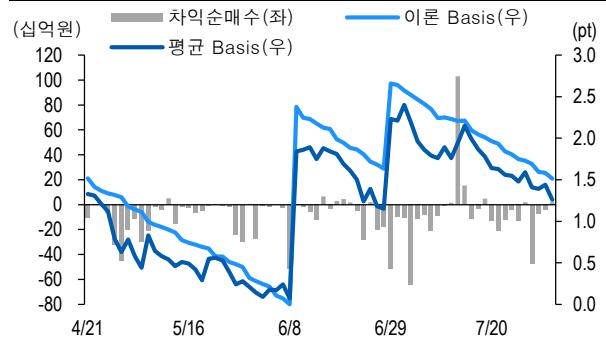
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	343.80	-2.05	-7.20	11,577.6	-
선물 9월물	344.80	-2.14	-7.55	23,245.2	285,395
선물 12월물	346.95	-2.07	-7.35	46.9	25,896
8월물(mini)	343.82	-2.13	-7.48	1,636.2	62,181
9월물(mini)	344.68	-2.18	-7.76	17.6	3,233



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.51	1.26	1.00	-0.07%
베이시스(mini)	0.28	0.22	0.02	-0.02%
제1스프레드(SP)	2.38	1.93	1.95	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.28	0.33	0.33	0.01%



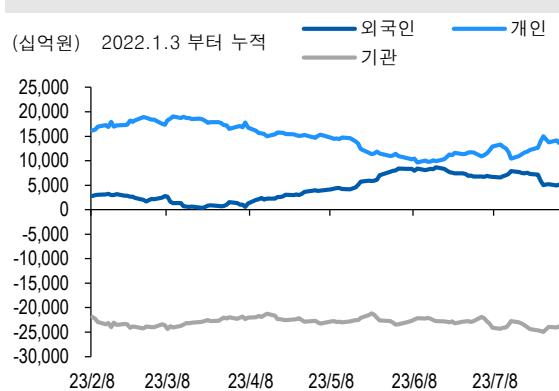
투자주체별 매매 동향

(십억원)

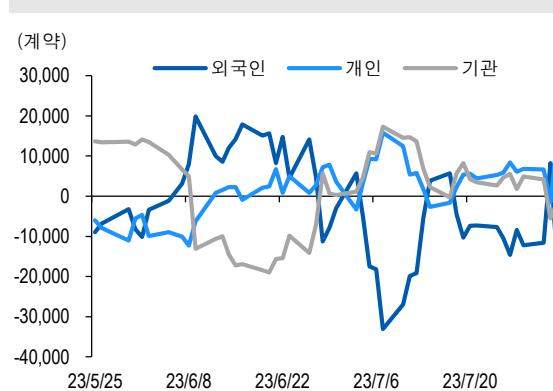
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-85.3	30.9	-54.3	0.0	-170.9	-2,295.2	164.7	0.1	-3.8	-20.1
개인	772.5	18.9	791.4	0.0	1.7	1,295.4	43.2	2.4	1.6	-58.2
기관	-686.1	-51.9	-738.1	1.9	-39.2	566.0	-209.8	-2.1	1.1	78.5
금융투자	-435.2	-65.2	-500.4	-0.2	3.9	1,234.0	-206.6	-2.2	1.2	101.4
투신	-98.7	-30.5	-129.2	0.0	-13.1	-663.2	-1.1	0.2	0.0	-25.2
은행+보험+기타금융	-16.6	34.8	18.2	0.0	-9.3	-11.2	-2.2	0.0	0.0	1.1
연기금+국가지자체	-56.4	9.0	-47.4	0.0	-31.4	6.4	0.0	0.0	0.0	1.3
기타법인	-1.1	-21.6	-22.7	0.0	0.4	433.9	1.9	-0.5	1.0	-0.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

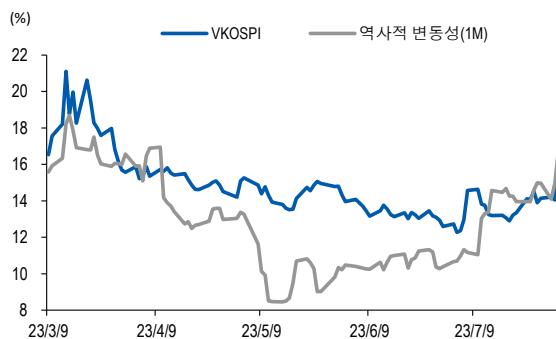
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)															
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	1,099,898	218.9	1,030,605	13.6%	지수옵션 전체	2,469,179	581.4	2,650,309							
Put	1,369,281	362.5	1,619,704	14.8%	PCR(금액기준)	1.66	VKOSPI	15.36%(+1.30%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	357.5(K+3)	0.11	-0.70	174,790	36,795	-750	13.6	Put	352.5(K+1)	8.96	5.38	3,588	1,966	139	14.4
	355.0(K+2)	0.23	-1.21	224,388	54,560	18,845	13.5		350.0(K+0)	6.77	4.39	28,820	8,965	452	13.6
	352.5(K+1)	0.48	-1.89	167,301	33,148	5,047	13.6		347.5(K-1)	5.01	3.50	75,794	15,434	-1,170	14.0
	350.0(K+0)	0.90	-2.78	125,244	42,117	9,665	13.6		345.0(K-2)	3.60	2.68	130,224	16,621	-1,022	14.6
	347.5(K-1)	1.62	-3.69	64,902	29,969	3,062	13.9		342.5(K-3)	2.53	1.96	166,948	21,337	-2,694	15.2

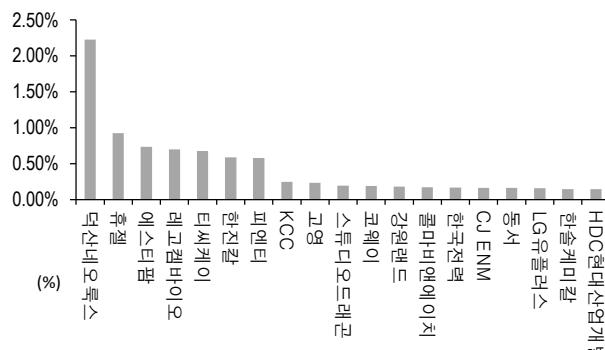
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)	(계약, 십억원)	
주식선물 전체	4,677,524	4,557.4	5,340,517	-46,417	-50,774	-70,836	124,076	-20.1	-58.2	78.5		
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수
삼성전자	70,000	-1.82	686.1	73.3	1,088,946	-31,984	0.04%	1,659	-18,604	16,630	20,357	-320
포스코퓨처엠	487,000	-4.70	296.9	67.0	28,295	-34	-0.01%	-322	85	241	255	215
SK 하이닉스	119,600	-4.55	294.8	65.0	198,008	-2,013	0.03%	4,364	-835	-4,111	2,860	-405
에코프로비엠	380,500	-7.08	463.1	64.7	47,028	-3,081	-0.13%	806	574	-1,311	-313	-40
영원무역	58,100	1.75	3.6	64.7	3,149	-542	-0.09%	-1,595	341	1,254	1,260	0
호텔신라	74,400	-1.20	11.2	57.1	10,029	1,626	0.05%	2,594	-346	-2,248	-2,359	111
HD 한국조선해양	122,000	-2.09	19.2	56.6	9,283	261	-0.11%	1,012	-116	-831	-544	-287
현대제철	35,900	-1.78	10.6	55.1	14,008	667	-0.07%	2,416	153	-2,569	-2,689	75
롯데에너지	54,800	-2.32	9.9	52.1	32,910	-1,974	-0.13%	-1,983	-808	2,794	2,731	112
한국전력	19,370	-0.77	11.1	51.7	91,067	5,607	0.17%	2,279	2,509	-4,795	-4,327	-457

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터