

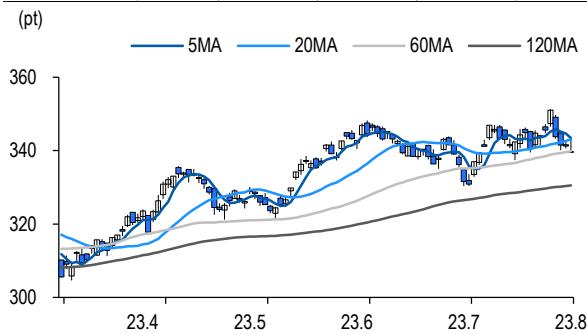


## 선물옵션시장 지표

2023.8.8

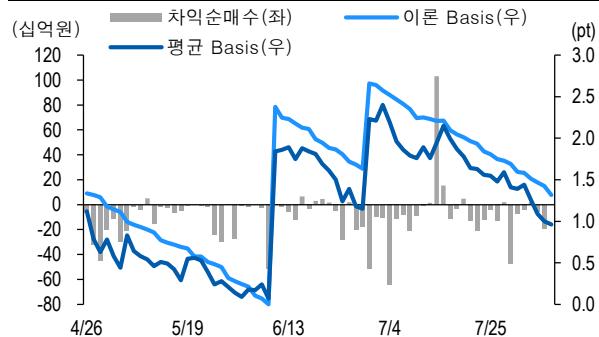
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	339.68	-0.46	-1.57	8,984.8	-
선물 9월물	340.95	-0.39	-1.35	19,074.9	278,059
선물 12월물	342.75	-0.44	-1.50	32.5	27,938
8월물(mini)	339.94	-0.42	-1.44	1,391.0	70,902
9월물(mini)	340.90	-0.41	-1.42	31.8	3,478



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.32	0.96	1.27	-0.10%
베이시스(mini)	0.10	-0.01	0.26	-0.03%
제1스프레드(SP)	2.34	1.90	1.90	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	0.29	0.29	0.05%



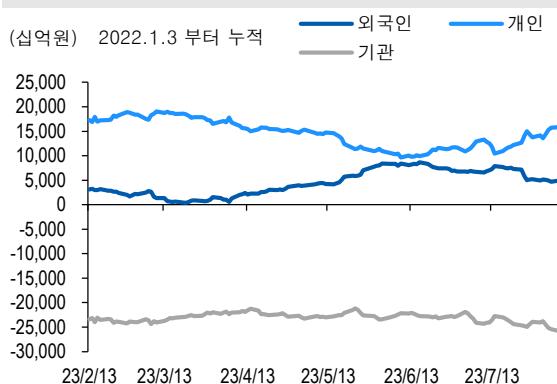
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

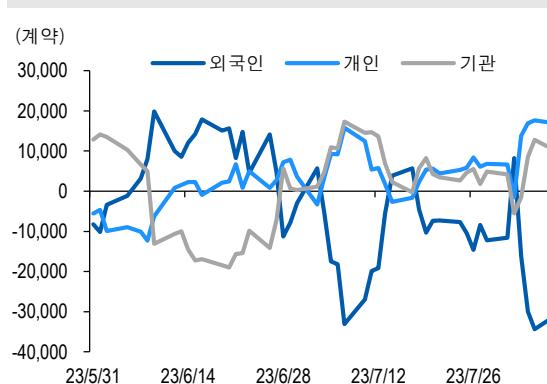
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	284.0	-0.6	283.4	0.0	269.4	286.9	1.1	2.7	-2.4	21.2
개인	28.5	58.9	87.4	0.0	2.5	-67.1	7.8	-1.7	2.9	-30.1
기관	-329.6	-37.6	-367.2	0.5	-87.0	-211.2	-7.9	1.2	0.2	9.2
금융투자	-170.3	-93.1	-263.3	-1.9	3.0	-26.6	-7.6	1.1	-0.1	18.5
투신	-27.2	13.6	-13.5	0.0	-11.4	-154.7	0.0	0.0	0.0	-6.6
은행+보험+기타금융	0.0	52.1	52.1	0.0	-6.9	-5.9	-0.3	0.0	0.3	0.4
연기금+국가지자체	-111.2	-6.6	-117.8	1.7	-70.8	-24.0	0.0	0.0	0.0	-3.1
기타법인	17.1	-0.8	16.3	0.0	-0.8	-8.7	-0.9	-2.1	-0.7	-0.3

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	1,470,515	285.6	1,147,255	15.8%	지수옵션 전체	2,791,297	587.8	2,864,764							
Put	1,320,782	302.2	1,717,509	16.1%	PCR(금액기준)	1.06	VKOSPI	15.71%(+0.16%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	350.0(K+3)	0.08	-0.20	218,697	58,963	6,616	15.6	Put	345.0(K+1)	5.57	0.73	13,286	16,133	-625	14.0
	347.5(K+2)	0.22	-0.38	305,248	44,242	7,045	15.6		342.5(K+0)	3.72	0.44	71,310	22,010	-1,533	14.9
	345.0(K+1)	0.55	-0.64	283,971	41,903	7,968	15.8		340.0(K-1)	2.25	0.15	222,330	32,808	2,379	15.2
	342.5(K+0)	1.19	-0.93	192,377	27,968	3,694	16.0		337.5(K-2)	1.29	0.01	266,366	27,127	1,656	16.0
	340.0(K-1)	2.23	-1.21	73,270	19,919	2,808	16.3		335.0(K-3)	0.70	-0.07	237,012	34,246	1,863	16.8

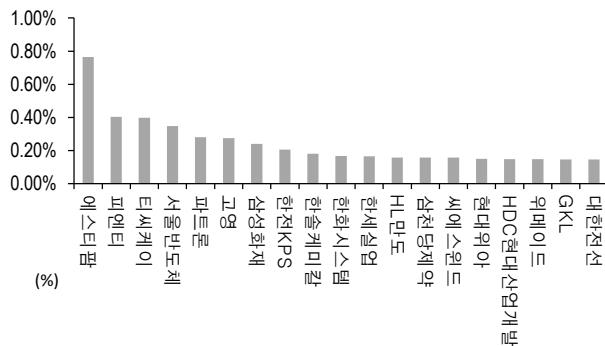
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	3,844,217	4,029.1	5,352,071	-769	11,996	-27,793	17,473	21.2	-30.1	9.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	68,600	0.29	538.3	71.8	912,882	-191,093	-0.02%	-244	-14,450	14,668
삼성전기	149,800	0.47	36.5	68.6	12,293	-2,993	-0.06%	-1,809	-253	2,061
카카오	52,600	2.14	84.8	58.1	145,452	-16,373	0.05%	9,619	-604	-9,001
포스코퓨처엠	439,500	-8.63	273.6	57.5	17,194	-7,460	0.02%	3,222	49	-3,274
SK 하이닉스	121,700	1.42	250.0	55.2	163,990	-16,510	-0.04%	667	-8,965	8,801
롯데에너지	50,700	-0.20	6.3	53.9	26,636	-2,792	-0.37%	693	-2,670	2,072
HD 한국조선해양	120,700	-0.66	11.7	52.7	8,289	-397	-0.12%	-580	-32	612
DB 하이텍	56,800	-1.05	6.8	52.4	14,282	-435	-0.04%	-495	-306	805
LG 전자	103,300	-0.48	39.4	49.6	32,803	-3,459	0.12%	1,447	-2,086	647
에코프로비엠	340,000	-10.64	345.8	48.4	38,484	-6,072	-0.06%	1,270	3,655	-4,925

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터