

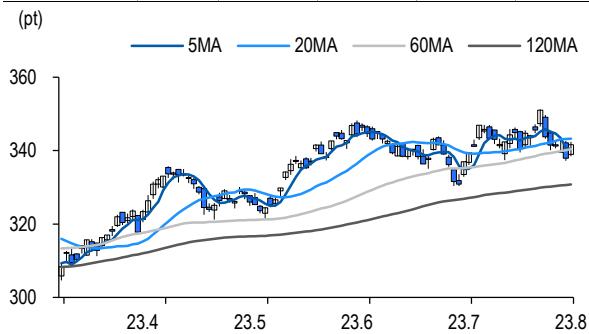


선물옵션시장 지표

2023.8.10

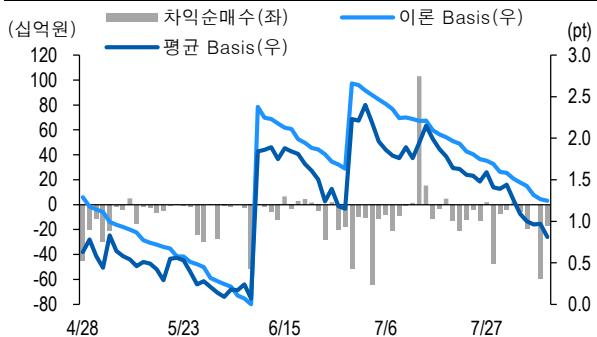
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	341.61	1.08	3.66	7,785.7	-
선물 9월물	342.50	0.99	3.35	18,759.0	275,794
선물 12월물	344.40	1.01	3.45	38.5	28,059
8월물(mini)	341.50	0.98	3.32	1,393.2	67,145
9월물(mini)	342.90	1.10	3.88	46.6	6,387



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.25	0.81	0.89	-0.13%
베이시스(mini)	0.03	-0.12	-0.11	-0.05%
제1스프레드(SP)	2.35	1.86	1.85	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.03	-0.12	-0.12	-0.05%



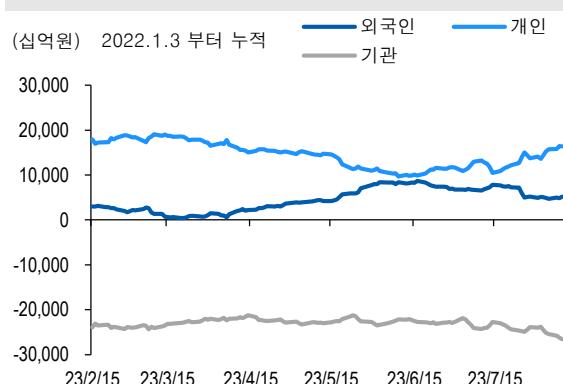
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	353.6	-8.3	345.3	0.0	120.7	575.6	-28.5	6.2	4.4	18.9
개인	-87.6	12.9	-74.7	0.0	1.6	-149.4	-46.8	-5.3	-3.3	-25.4
기관	-292.6	-8.5	-301.1	-16.6	-88.4	-516.9	77.1	1.5	0.7	14.1
금융투자	-158.8	-10.6	-169.4	-16.9	-4.3	-839.8	86.8	1.9	0.8	6.8
투신	-64.7	-18.5	-83.1	0.0	-30.1	344.6	-0.6	-0.6	0.0	5.6
은행+보험+기타금융	9.1	21.2	30.3	0.0	-11.2	18.9	-9.1	0.1	0.0	0.1
연기금+국가지자체	-26.6	-0.6	-27.2	0.0	-30.4	-40.7	0.0	0.1	-0.1	1.6
기타법인	26.6	5.2	31.8	0.0	0.4	90.6	-1.7	-2.5	-1.8	-7.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	1,689,197	328.3	1,230,093	10.4%	지수옵션 전체	3,472,860	554.9	3,083,471						
Put	1,783,663	226.7	1,853,378	15.0%	PCR(금액기준)	0.69	VKOSPI	14.15%(-1.25%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
Call	345.0(K+3)	0.16	0.05	490,667	44,692	-2,013	11.0	340.0(K+1)	0.59	-2.26	312,810	41,037	10,896	12.5
	342.5(K+2)	0.74	0.38	495,174	34,008	-519	10.9	337.5(K+0)	0.16	-1.35	420,758	35,714	10,537	13.1
Put	340.0(K+1)	2.11	1.14	266,597	27,834	-1,376	10.6	335.0(K-1)	0.06	-0.67	367,115	46,427	10,078	15.2
	337.5(K+0)	4.15	1.99	57,208	13,425	-379	0.1	332.5(K-2)	0.03	-0.29	209,731	40,013	7,473	17.7
	335.0(K-1)	6.59	2.74	8,795	4,257	24	1.8	330.0(K-3)	0.02	-0.12	120,317	39,900	-9,394	20.6

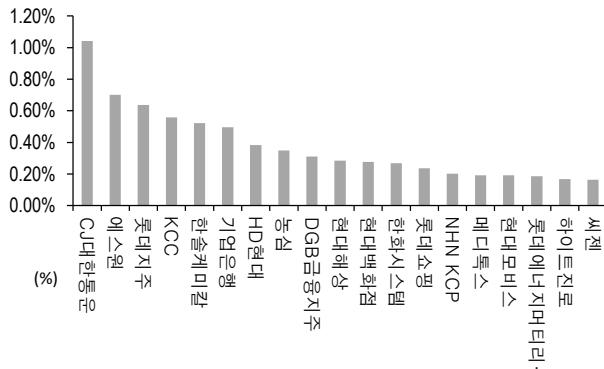
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,160,502	4,061.2	5,284,609	-18,249	22,839	-50,103	33,956	18.9	-25.4	14.1		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수		
SK	152,400	0.33	10.8	84.5	11,349	-3,180	0.01%	1,083	-1,098	14	91	-77
삼성전자	69,000	2.22	882.5	74.5	534,044	-169,018	-0.12%	-3,299	-45,656	56,874	58,022	-1,700
포스코퓨처엠	456,000	1.90	185.6	72.3	9,628	-4,427	0.05%	-341	52	287	-71	-179
SK 하이닉스	118,700	-0.50	216.5	72.2	87,081	-63,686	0.02%	96	5,719	-5,840	-7,184	1,219
에코프로비엠	343,500	1.18	249.1	67.3	20,715	-10,727	-0.05%	355	-786	1,243	932	0
현대차	189,500	0.69	42.0	60.8	22,705	-14,707	-0.01%	941	465	-1,316	-1,655	339
LG 화학	627,000	1.79	75.9	59.9	4,636	-1,416	0.07%	599	-111	-406	-678	272
LG 이노텍	260,500	-0.57	16.3	59.8	9,481	-1,767	0.13%	776	-127	-649	-608	-41
한국항공우주	48,250	1.47	14.0	55.4	8,131	-266	0.08%	4,622	152	-4,750	-1,501	-3,249
HD 한국조선해양	122,000	-0.73	10.3	52.2	4,173	-1,345	-0.04%	360	234	-594	-913	319

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터