

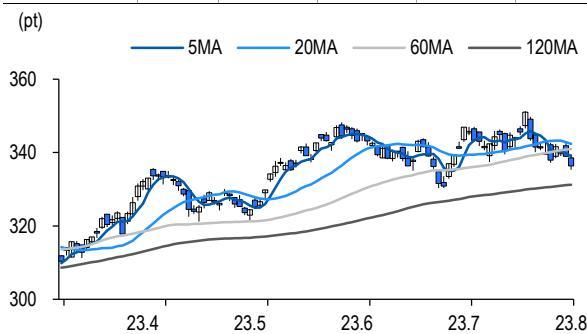


선물옵션시장 지표

2023.8.16

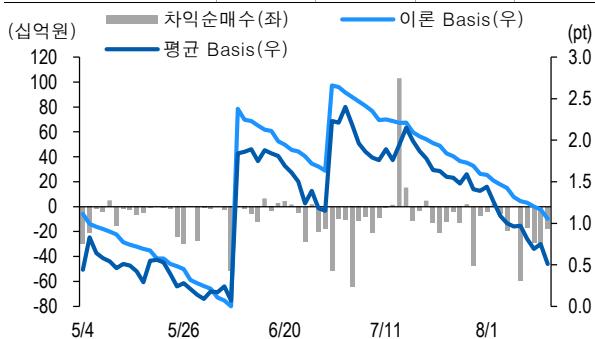
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	336.33	-0.78	-2.65	6,924.9	-
선물 9월물	337.25	-0.94	-3.20	18,061.1	273,900
선물 12월물	339.00	-0.96	-3.30	81.0	28,937
9월물(mini)	337.20	-0.96	-3.18	1,018.5	19,179
10월물(mini)	337.22	-0.82	-2.78	3.2	16,868



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.05	0.51	0.92	-0.16%
베이시스(mini)	1.05	0.51	0.87	-0.16%
제1스프레드(SP)	2.26	1.84	1.80	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	1.05	0.98	0.98	-0.02%



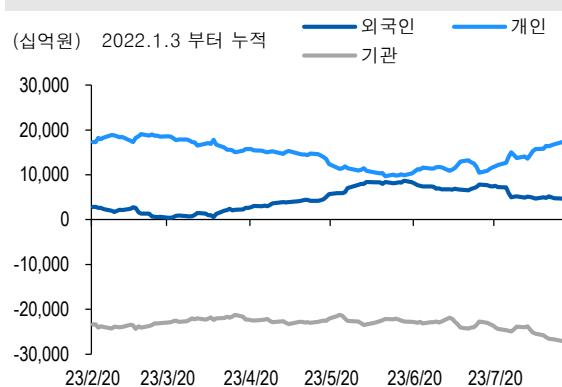
투자주체별 매매 동향

(십억원)

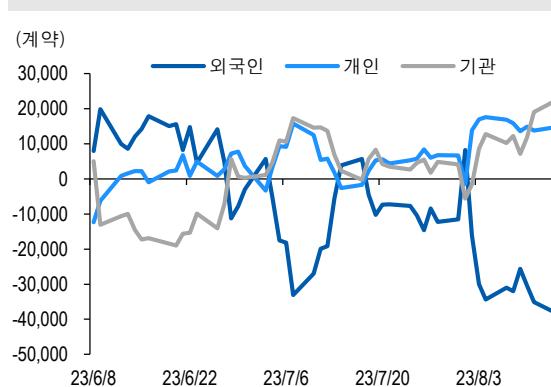
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-118.0	0.2	-117.9	0.0	-16.8	-205.1	-46.5	1.6	-0.2	-10.5
개인	427.6	37.8	465.4	0.0	3.5	34.7	37.5	-2.5	-0.6	-2.5
기관	-333.1	-19.7	-352.8	-17.2	-31.9	257.5	7.1	1.3	0.5	29.4
금융투자	-265.1	-40.5	-305.6	-16.6	-4.5	372.4	7.1	1.6	0.5	24.7
투신	-2.5	-16.6	-19.1	0.0	-3.1	-104.7	0.6	-0.3	0.0	2.5
은행+보험+기타금융	-2.8	47.5	44.7	-0.6	-3.5	9.3	-0.6	0.0	0.0	1.5
연기금+국가지자체	-34.2	-12.4	-46.6	0.0	-25.8	-19.5	0.0	0.0	0.0	0.7
기타법인	23.5	-27.1	-3.6	0.0	1.0	-87.2	1.9	-0.4	0.3	-16.4

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	614,833	193.5	727,125	12.4%	지수옵션 전체	1,161,025	397.9	1,904,089							
Put	546,192	204.4	1,176,964	13.5%	PCR(금액기준)	1.06	VKOSPI	14.14% (+0.70%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	347.5(K+3)	1.50	-0.75	66,333	9,943	2,604	12.4	Put	342.5(K+1)	8.15	1.87	1,858	4,744	-4	13.1
	345.0(K+2)	2.13	-0.96	60,352	12,017	1,817	12.5		340.0(K+0)	6.60	1.52	8,578	12,676	-29	13.1
	342.5(K+1)	2.93	-1.22	31,076	7,007	2,492	12.7		337.5(K-1)	5.29	1.24	12,723	9,553	931	13.2
	340.0(K+0)	3.91	-1.50	21,446	14,513	914	12.8		335.0(K-2)	4.18	1.03	23,824	14,560	2,424	13.4
	337.5(K-1)	5.10	-1.67	10,275	2,248	1,201	12.9		332.5(K-3)	3.26	0.82	27,379	9,369	172	13.6

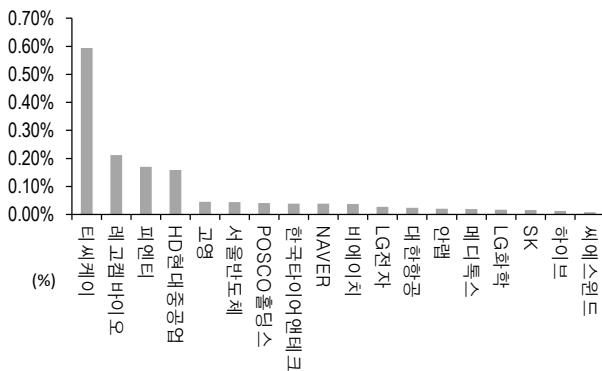
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,282,631	2,845.3	4,372,625	49,385	-63,277	-27,099	111,681	-10.5	-2.5	29.4
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
한세실업	21,650	6.65	8.3	93.3	3,507	981	-0.77%	745	-315	-430
삼성전자	67,400	-0.59	547.3	87.1	1,080,551	-42,419	-0.05%	19,973	-38,654	35,679
SK 하이닉스	115,500	-0.52	173.0	73.7	182,968	6,755	0.01%	4,069	3,139	-7,188
현대차	188,700	-1.20	39.7	70.9	31,688	-1,561	-0.18%	1,703	-2,570	816
포스코퓨처엠	436,000	-1.36	134.8	69.8	24,465	-1,611	-0.02%	-312	1,990	-1,649
에코프로비엠	319,500	-1.69	182.8	62.4	52,545	637	-0.21%	-925	2,418	-1,348
한국항공우주	48,000	-2.83	15.2	60.9	9,618	-5,134	-0.08%	-7,586	347	7,239
현대제철	34,700	-0.57	6.7	60.7	6,384	514	-0.05%	158	27	-185
삼성전기	148,200	-2.18	27.1	60.7	9,856	1,292	-0.04%	-239	607	-368
NAVER	221,500	-0.67	73.7	58.3	52,338	858	0.04%	-480	796	-316

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터