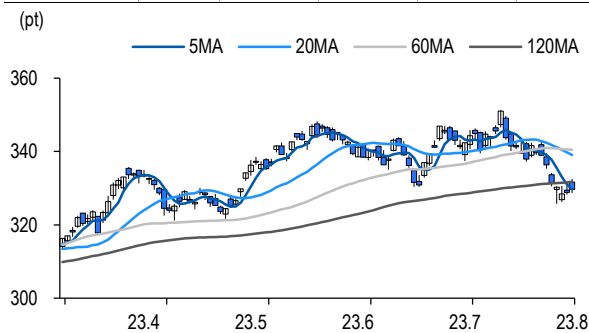


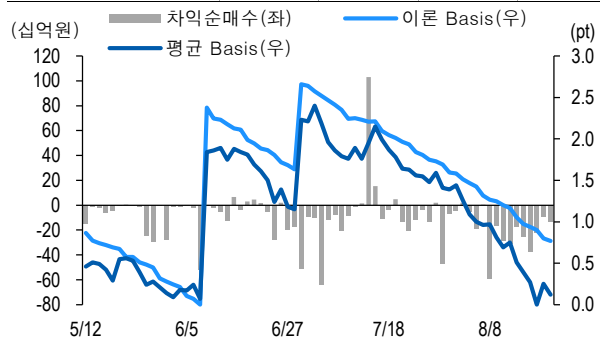
선물옵션시장 지표

2023.8.23

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	329.70	0.26	0.86	5,364.6	-
선물 9월물	330.00	0.32	1.05	17,762.6	289,099
선물 12월물	331.70	0.33	1.10	66.2	34,785
9월물(mini)	330.00	0.32	1.06	1,257.0	30,014
10월물(mini)	330.02	0.32	1.04	3.9	20,590



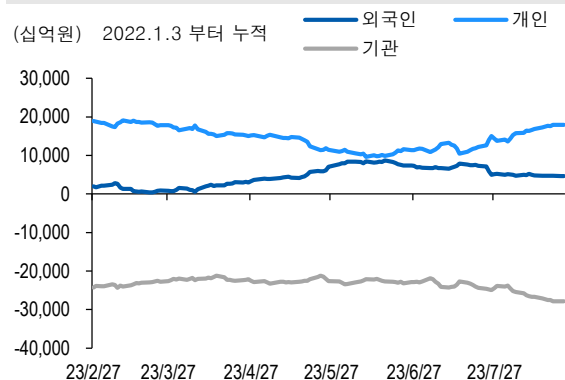
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.77	0.12	0.30	-0.20%
베이스(mini)	0.77	0.12	0.30	-0.20%
제1스프레드(SP)	2.22	1.68	1.70	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	0.77	0.28	0.28	-0.15%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-41.2	7.2	-34.0	0.0	-93.2	113.7	-7.9	-1.2	-0.5	28.1
개인	50.8	-15.8	35.0	0.0	9.9	-78.1	-14.9	0.4	-0.1	21.3
기관	-5.7	6.5	0.8	-13.2	-60.9	29.2	20.7	0.2	0.9	-49.0
금융투자	-12.9	18.5	5.5	-12.5	-22.7	109.9	22.1	0.2	0.9	-54.8
투신	0.0	-0.7	-0.6	0.0	-0.7	-48.8	-1.4	0.0	0.0	9.4
은행+보험+기타금융	20.3	-18.1	2.2	0.0	-1.0	-34.0	-0.1	0.0	0.0	0.0
연기금+국가자재	-28.0	2.8	-25.2	0.0	-29.9	2.1	0.0	0.0	0.0	-3.6
기타법인	-3.8	2.1	-1.7	0.0	0.7	-64.8	2.1	0.5	-0.3	-0.4

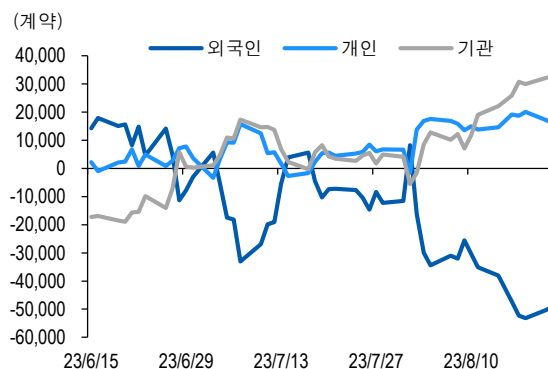
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



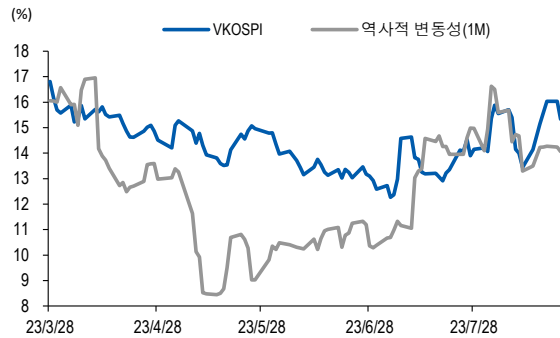
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	592,528	166.2	896,575	13.0%	지수옵션 전체	1,343,882	340.4	2,333,744			
Put	751,354	174.2	1,437,169	15.6%	PCR(금액기준)	1.05	VKOSPI	15.33%(-0.70%p)			

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	337.5(K+3)	1.79	0.07	53,416	14,624	-802	13.0	Put	332.5(K+1)	6.09	-0.85	5,493	9,471	502	14.9
	335.0(K+2)	2.60	0.08	35,900	18,351	-325	13.2		330.0(K+0)	4.83	-0.76	13,923	18,614	-278	15.1
	332.5(K+1)	3.60	0.20	15,892	9,593	850	13.4		327.5(K-1)	3.76	-0.71	17,218	12,350	-547	15.2
	330.0(K+0)	4.81	0.24	12,050	13,852	-344	13.5		325.0(K-2)	2.88	-0.64	29,799	20,860	-172	15.5
	327.5(K-1)	6.25	0.30	2,558	4,031	-179	13.7		322.5(K-3)	2.20	-0.54	41,115	15,110	-221	15.8

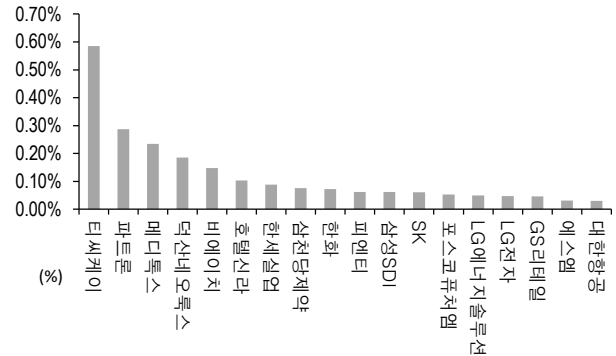
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 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	3,149,850	2,772.4	5,249,378	155,321	13,028	43,207	-57,354	28.1	21.3	-49.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한세실업	20,450	-1.68	5.5	181.9	3,772	-675	0.09%	3,180	-166	-3,025	-3,025	0
SK 하이닉스	116,600	-0.34	342.0	91.7	217,815	20,772	0.01%	2,707	14,354	-16,979	-20,555	146
삼성전기	144,200	1.19	37.6	90.4	11,478	-750	-0.03%	1,205	397	-1,588	-2,169	161
삼성전자	66,800	0.15	581.0	82.9	1,271,720	33,153	-0.03%	4,795	-30,927	26,175	26,235	1,690
메디톡스	223,500	-1.11	12.5	78.7	21,890	2,091	0.23%	-336	2,999	-2,662	-2,392	0
한국금융지주	51,100	0.99	2.9	72.7	10,796	379	-0.16%	-537	39	497	507	-10
카카오	48,650	0.31	39.6	71.9	289,293	-41,355	-0.05%	-2,295	9,074	-6,779	-5,615	-1,033
SK 이노베이션	176,900	0.74	46.5	71.0	41,906	2,007	-0.43%	-2,295	-643	2,938	2,232	0
한국항공우주	48,050	0.63	12.1	68.4	15,737	-1,711	-0.06%	1,474	-368	-1,107	-182	-925
에스엠	131,300	-0.08	11.9	63.8	35,910	1,025	0.03%	205	2,283	-2,486	-2,486	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터