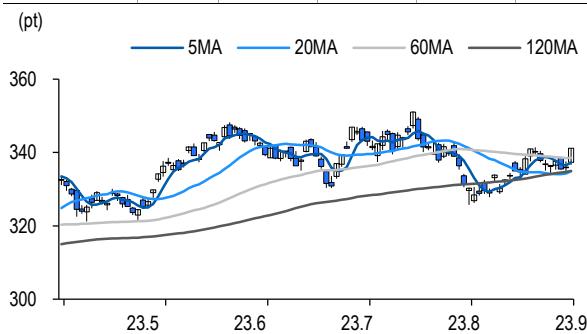


선물옵션시장 지표

02-3770-3528 투자전략팀

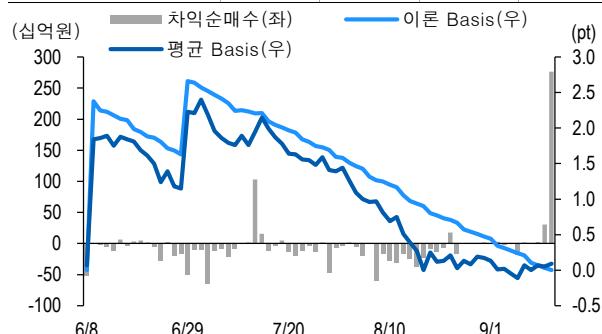
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	341.19	1.55	5.20	7,221.5	-
선물 9월물	340.30	1.25	4.20	10,966.0	0
선물 12월물	342.65	1.50	5.05	9,719.4	238,924
9월물(mini)	340.28	1.24	4.30	579.6	0
10월물(mini)	340.70	1.42	4.78	958.1	77,416



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.00	0.09	-0.89	0.03%
베이시스(mini)	0.00	0.09	-0.91	0.03%
제1스프레드(SP)	2.36	1.58	1.55	-0.23%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	-1.03	-1.03	-0.30%



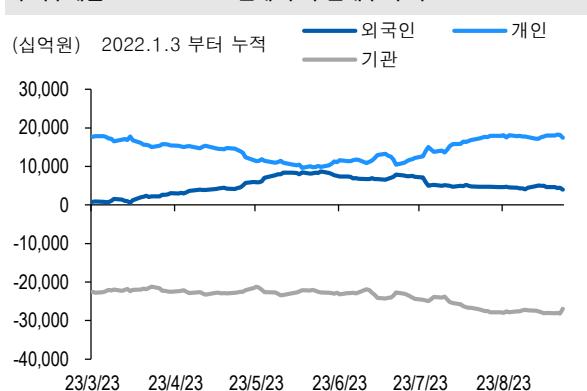
투자주체별 매매 동향

(십억원)

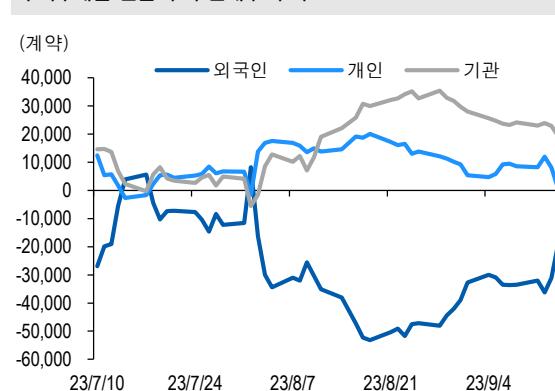
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-518.8	19.9	-498.9	-34.2	-471.3	1,049.9	20.3	-1.6	0.0	-12.6
개인	-707.7	-74.0	-781.7	0.0	8.6	-645.3	-29.6	0.2	-1.3	-63.9
기관	1,217.4	24.8	1,242.2	310.8	279.6	-314.8	3.8	1.9	1.9	72.6
금융투자	986.9	84.5	1,071.4	311.3	137.9	-492.4	-0.5	2.9	1.8	113.0
투신	95.6	-44.6	51.0	0.0	39.1	244.9	4.7	-0.7	0.1	18.3
은행+보험+기타금융	-11.1	1.3	-9.8	1.7	-10.0	6.0	-0.4	-0.3	0.0	0.3
연기금+국가지자체	40.5	-16.4	24.1	-2.2	72.2	-73.2	0.0	0.0	0.0	-59.0
기타법인	9.1	-2.4	6.7	0.0	1.3	-89.9	5.6	-0.5	-0.5	3.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이

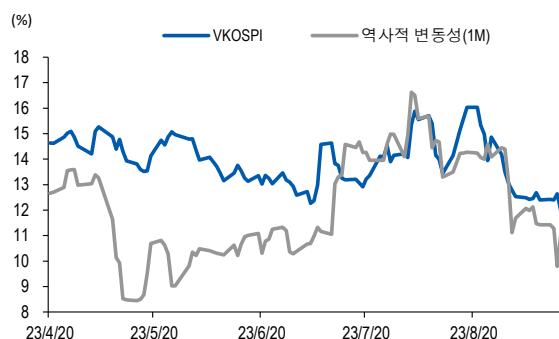


자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	1,602,647	285.7	539,510	5.4%	지수옵션 전체		3,327,369	454.8	1,450,736		
Put	1,724,722	169.1	911,226	13.1%	PCR(금액기준)		0.59	VKOSPI	12.02%(-0.62%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	Put	행사가	종가	등락(pt)
	342.5(K+3)	0.01	-0.01	125,344	0	-52,764	4.0		337.5(K+1)	0.02	-1.97
	340.0(K+2)	0.45	0.37	867,634	0	-54,245	1.5		335.0(K+0)	0.01	-0.73
	337.5(K+1)	2.80	2.27	393,028	0	-38,474	12.8		332.5(K-1)	0.01	-0.20
	335.0(K+0)	5.17	3.43	68,533	0	-25,426	12.2		330.0(K-2)	0.01	-0.04
	332.5(K-1)	7.80	4.05	6,722	0	-11,213	28.4		327.5(K-3)	0.01	-0.01

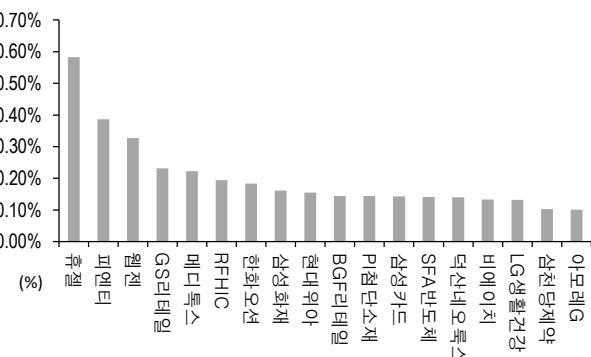
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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	4,590,728	3,737.9	4,299,981	-1,618,480	-29,061	-76,709	101,553	-12.6	-63.9	72.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	71,700	0.84	613.0	41.0	0	-467,807	-0.06%	-26,952	-15,285	39,623
SK	147,700	0.54	8.2	40.2	0	-7,679	-0.08%	-1,794	-1,146	2,932
SK 하이닉스	121,400	2.19	169.8	35.7	0	-94,572	-0.08%	-6,882	-9,791	16,557
씨젠	22,800	1.11	4.4	33.7	0	-34,897	0.04%	50	-539	489
천보	142,300	1.50	2.5	32.6	0	-9,903	0.01%	-194	-131	328
한국전력	18,110	0.61	5.6	32.0	0	-51,976	-0.02%	7,017	-9,724	2,763
현대제철	39,000	1.17	4.3	27.7	0	-22,080	-0.02%	-1,093	1,126	-33
메디톡스	296,500	1.02	9.4	25.7	0	-9,122	0.22%	246	439	-682
에코프로비엠	284,500	3.45	51.7	25.5	0	-16,772	-0.04%	546	-1,321	430
대우건설	4,450	0.79	1.0	20.6	0	-22,574	-0.18%	-2,305	2,293	12

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터