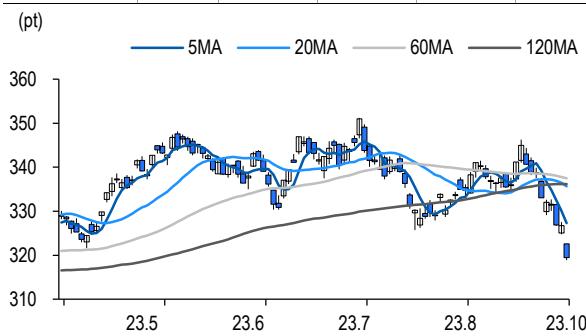


선물옵션시장 지표

02-3770-3528 투자전략팀

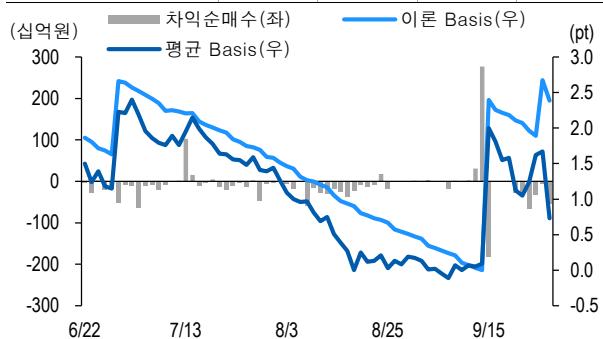
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	319.45	-2.22	-7.26	8,064.0	-
선물 12월물	320.10	-2.71	-8.90	24,546.1	290,680
선물 3월물	319.60	-2.58	-8.45	40.6	29,703
10월물(mini)	318.92	-2.63	-8.60	1,819.9	119,674
11월물(mini)	319.44	-2.55	-8.36	10.8	22,504



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.39	0.73	0.65	-0.52%
베이시스(mini)	0.27	-0.35	-0.53	-0.19%
제1스프레드(SP)	-1.39	-0.80	-0.80	0.18%
합성선물 베이시스(ATM)	0.27	-0.60	-0.60	-0.27%



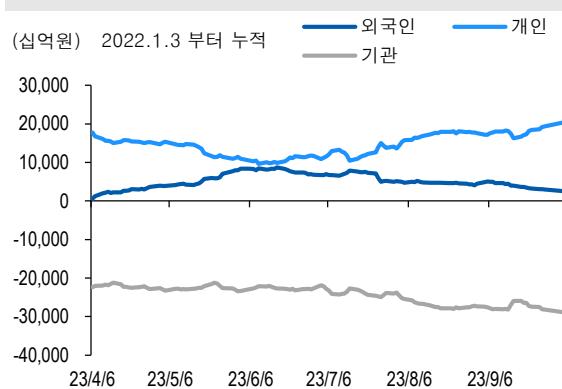
투자주체별 매매 동향

(십억원)

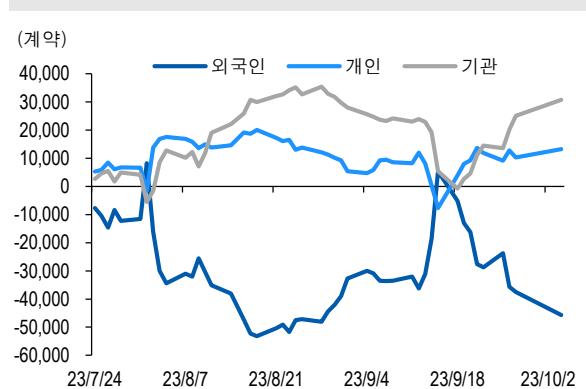
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-398.7	0.2	-398.4	0.0	-233.2	-550.5	-103.1	2.9	-4.9	-30.5
개인	833.8	151.1	984.9	0.0	1.2	233.4	7.3	-5.0	8.4	14.7
기관	-469.6	-207.6	-677.2	-54.4	-80.7	369.2	94.1	2.5	-5.5	14.2
금융투자	-359.5	-229.5	-589.0	-40.4	-54.9	667.8	96.8	2.7	-5.0	31.2
투신	-32.4	0.2	-32.2	-8.0	-4.7	-276.3	-3.2	-0.2	-0.2	-18.9
은행+보험+기타금융	-41.2	21.6	-19.5	-1.1	-1.1	-15.6	0.5	0.0	-0.2	-0.6
연기금+국가지자체	13.9	-13.9	0.0	0.0	-3.8	-6.6	0.0	0.0	0.0	2.5
기타법인	34.4	-34.4	0.0	0.0	3.8	-52.1	1.7	-0.4	2.0	1.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



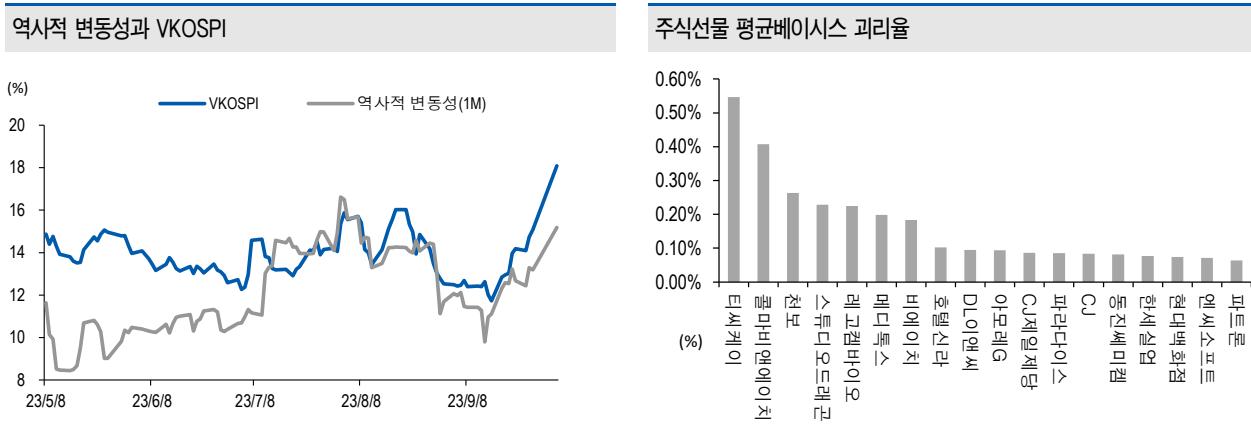
투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

지수옵션 시장동향										(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	963,845	168.9	959,892	13.8%	지수옵션 전체		2,126,740	520.1	2,317,790		
Put	1,162,895	351.1	1,357,898	18.1%	PCR(금액기준)		2.08	VKOSPI	18.09% (+3.01%)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	335.0(K+3)	0.05	-0.80	87,004	29,858	4,632	14.3	330.0(K+1)	11.20	6.28	2,760
	332.5(K+2)	0.10	-1.39	130,272	30,941	15,370	13.8	327.5(K+0)	9.10	5.49	4,674
	330.0(K+1)	0.21	-2.12	180,551	30,791	14,623	13.5	325.0(K-1)	6.91	4.36	14,357
	327.5(K+0)	0.45	-3.03	130,989	20,119	12,883	13.6	322.5(K-2)	5.14	3.34	24,269
	325.0(K-1)	0.93	-3.97	105,854	18,175	11,557	13.9	320.0(K-3)	3.72	2.53	71,173
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	330.0(K+3)	0.05	-0.80	87,004	29,858	4,632	14.3	330.0(K+1)	11.20	6.28	2,760
	327.5(K+2)	0.10	-1.39	130,272	30,941	15,370	13.8	327.5(K+0)	9.10	5.49	4,674
	330.0(K+1)	0.21	-2.12	180,551	30,791	14,623	13.5	325.0(K-1)	6.91	4.36	14,357
	327.5(K+0)	0.45	-3.03	130,989	20,119	12,883	13.6	322.5(K-2)	5.14	3.34	24,269
	325.0(K-1)	0.93	-3.97	105,854	18,175	11,557	13.9	320.0(K-3)	3.72	2.53	71,173

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,437,767	3,315.9	5,424,678	261,590	-142,533	18,015	122,702	-30.5	14.7	14.2	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수
한세실업	19,440	-1.62	2.7	139.3	4,628	683	0.08%	877	53	-930	-930
SK 하이닉스	115,200	0.44	382.3	81.9	236,883	-16,161	-0.07%	-12,094	347	13,411	15,776
한샘	54,600	-3.36	1.4	74.7	1,382	264	-0.22%	-93	-137	230	230
영원무역	47,700	-1.75	3.8	72.7	4,754	-295	-0.16%	-608	-12	620	620
아모레 G	29,850	-2.13	4.3	65.8	15,738	2,448	0.09%	1,502	1,604	-3,106	-3,145
후성	9,710	-3.29	5.0	64.0	25,332	4,755	-1.73%	-4,156	120	4,036	3,638
한국금융지주	51,800	-2.81	4.4	62.5	13,763	666	-0.15%	-31	-746	777	777
삼성전자	67,500	-1.60	848.8	56.2	1,187,523	45,770	-0.04%	16,906	18,172	-37,221	-35,692
현대제철	36,650	-3.81	10.2	54.6	25,853	5,630	-0.02%	1,113	1,639	-2,793	-2,223
포스코인터내셔널	67,500	-5.46	50.4	53.5	29,115	-5,860	-0.11%	3,096	10,283	-13,354	-9,505

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터