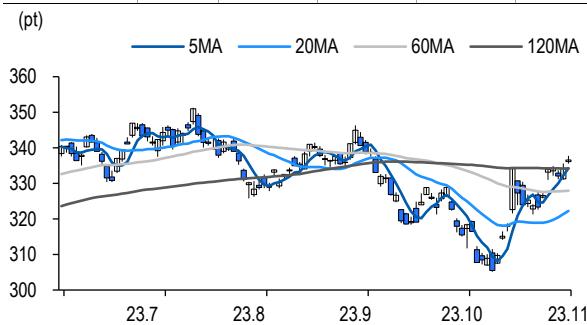


선물옵션시장 지표

02-3770-3528 투자전략팀

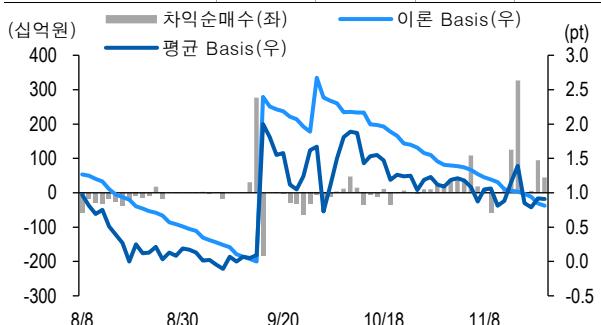
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	336.57	0.70	2.34	4,294.7	-
선물 12월물	337.45	0.57	1.90	17,058.2	278,976
선물 3월물	336.70	0.58	1.95	106.0	29,489
12월물(mini)	337.38	0.54	1.84	1,144.0	48,233
1월물(mini)	334.64	0.42	1.40	3.8	10,017



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.81	0.91	0.88	0.03%
베이시스(mini)	0.81	0.91	0.81	0.03%
제1스프레드(SP)	-1.20	-0.64	-0.65	0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.81	0.80	0.80	0.00%



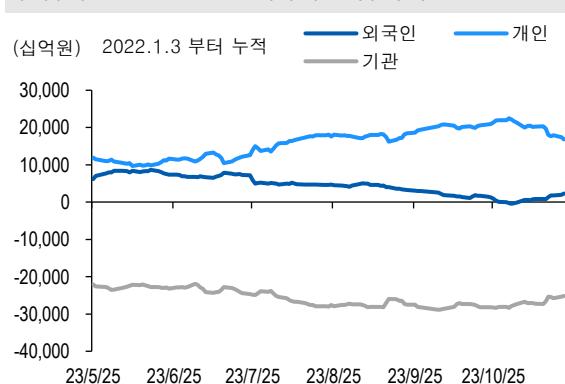
투자주체별 매매 동향

(십억원)

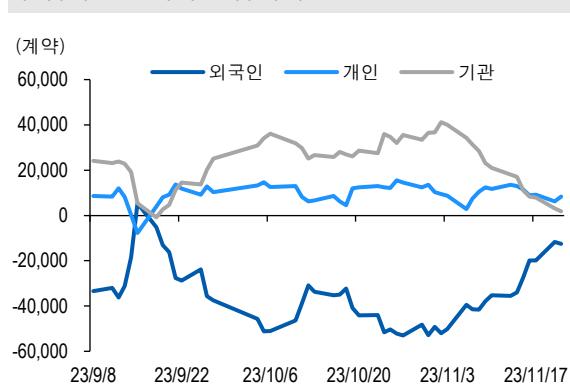
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	351.7	31.1	382.8	0.0	356.9	-60.8	-3.6	5.8	2.0	-14.0
개인	-438.4	-121.8	-560.2	0.0	-5.7	169.0	6.7	-4.1	-2.9	-2.8
기관	110.2	80.7	190.9	44.5	-40.4	-101.7	-4.0	-0.9	2.9	14.4
금융투자	115.1	119.0	234.1	44.5	7.8	81.5	-3.5	-1.0	2.8	6.2
투신	6.1	-1.8	4.2	0.0	-11.5	-193.6	-0.5	0.0	0.0	-3.3
은행+보험+기타금융	-4.4	-30.1	-34.5	0.0	-12.4	12.6	0.0	0.0	0.0	0.3
연기금+국가지자체	2.6	-0.9	1.7	0.0	-25.3	-2.2	0.0	0.0	0.0	11.2
기타법인	-23.4	-7.8	-31.2	0.0	0.0	-6.5	0.9	-0.7	-2.0	2.4

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	563,453	189.3	778,190	14.8%	지수옵션 전체	1,102,495	320.2	2,120,674							
Put	539,042	130.9	1,342,484	15.8%	PCR(금액기준)	0.69	VKOSPI	16.18%(-0.50%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	342.5(K+3)	3.01	0.41	27,293	14,395	753	14.9	Put	337.5(K+1)	5.24	-1.23	5,900	2,360	1,095	15.1
	340.0(K+2)	3.97	0.52	14,348	30,917	-1,862	14.9		335.0(K+0)	4.12	-1.07	13,962	9,196	1,970	15.3
	337.5(K+1)	5.14	0.66	12,395	14,583	-1,997	15.0		332.5(K-1)	3.19	-0.96	12,804	4,873	1,356	15.5
	335.0(K+0)	6.49	0.80	5,045	15,635	100	15.1		330.0(K-2)	2.43	-0.80	28,745	21,253	1,423	15.7
	332.5(K-1)	8.01	0.84	1,322	10,863	379	15.2		327.5(K-3)	1.85	-0.68	31,843	9,559	608	16.0

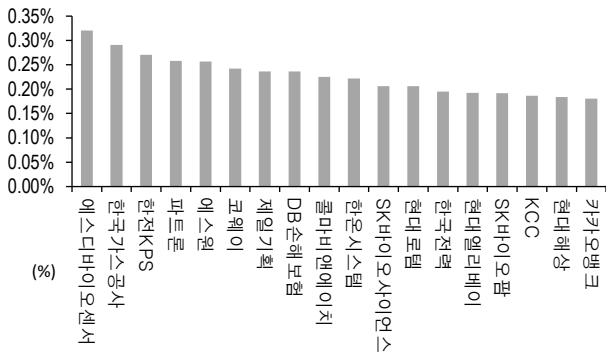
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,192,135	1,991.9	6,660,822	118,424	-1,349	-9,993	7,648	-14.0	-2.8	14.4
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
LG 에너지솔루션	447,000	0.00	70.1	99.3	30,980	325	-0.22%	-1,054	455	603
POSCO 홀딩스	471,500	-0.42	182.5	92.6	37,938	-158	-0.12%	-518	-192	712
에코프로비엠	245,000	-2.20	188.2	83.9	59,700	-864	-0.63%	-3,859	1,579	2,412
삼성전자	72,900	-0.14	485.9	68.9	1,193,495	12,601	0.03%	2,939	-13,097	10,337
삼성전기	138,400	-0.43	20.7	67.1	16,588	3,072	0.17%	169	804	-1,720
LG 화학	502,000	1.41	52.8	61.2	19,359	-201	-0.03%	-160	-33	195
한화오션	22,200	2.54	14.4	59.2	445,429	16,825	-17.71%	-9,863	-2,635	12,728
LG 전자	109,000	1.49	34.9	58.2	35,267	2,427	0.06%	956	-1,470	415
포스코퓨처엠	302,500	0.67	100.5	57.4	30,626	-1,318	-0.21%	-602	-767	1,374
SK 하이닉스	132,200	0.38	172.9	53.7	243,946	-4,667	-0.04%	-1,300	-2,959	4,853

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터