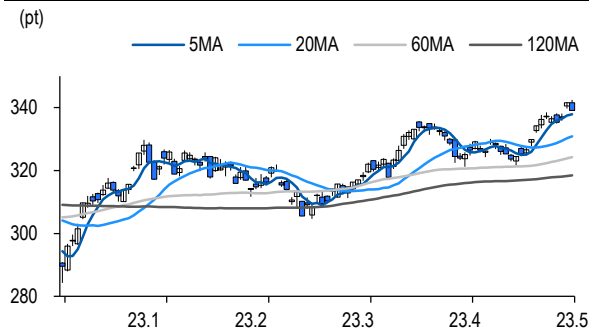


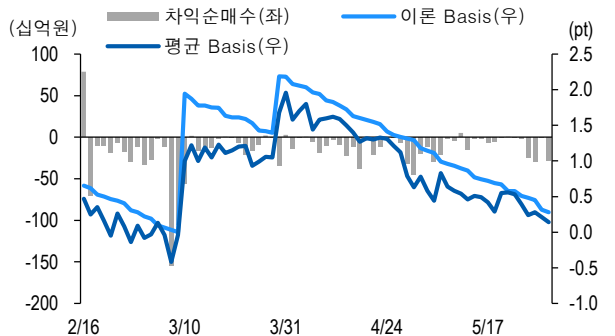
선물옵션시장 지표

2023.6.1

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	339.12	-0.70	-2.38	10,876.1	-
선물 6월물	339.00	-0.89	-3.05	20,218.8	320,407
선물 9월물	340.70	-0.86	-2.95	234.5	37,297
6월물(mini)	338.96	-0.91	-3.08	856.7	41,262
7월물(mini)	338.92	-0.88	-3.00	12.5	31,971

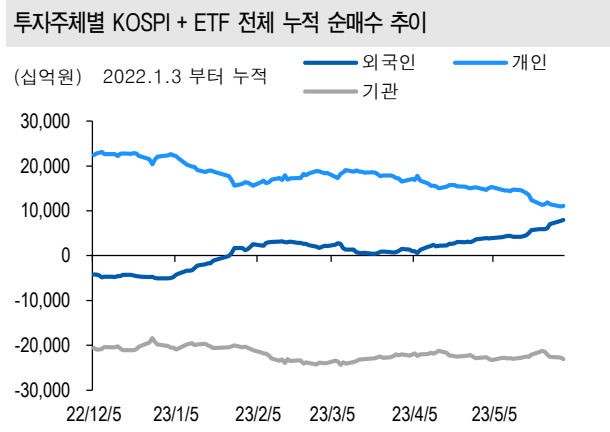


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.28	0.14	-0.12	-0.04%
베이스(mini)	0.28	0.14	-0.16	-0.04%
제1스프레드(SP)	2.34	1.72	1.70	-0.18%
합성선물 베이스(ATM)	0.28	-0.08	-0.08	-0.11%

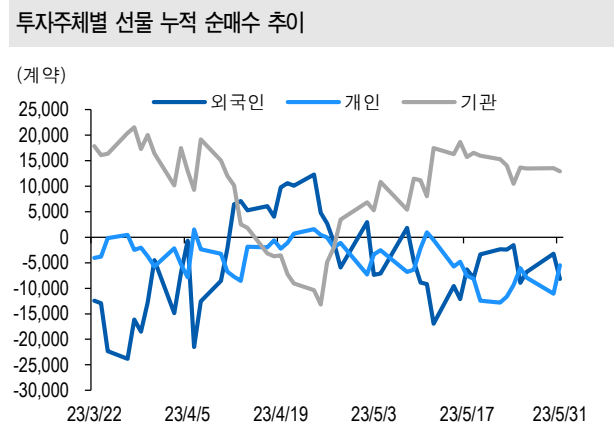


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	220.0	4.4	224.3	-20.7	-23.8	-403.2	-21.5	-2.5	0.7	-28.0
개인	63.0	65.5	128.5	0.0	-6.6	443.6	28.1	1.7	-1.4	24.9
기관	-286.9	-51.3	-338.3	-7.0	-33.7	-48.0	-6.0	0.5	1.2	0.9
금융투자	-33.9	-63.7	-97.6	-6.9	0.2	399.9	-5.6	0.4	1.2	0.0
투신	-37.3	-7.2	-44.5	0.0	-3.5	-445.4	-0.4	0.1	0.0	-0.7
은행+보험+기타금융	-6.8	8.3	1.5	0.0	-8.2	5.1	-0.1	0.0	0.0	-0.3
연기금+국가자재	-74.4	11.1	-63.4	1.7	-14.7	-7.5	0.0	0.0	0.0	1.9
기타법인	3.9	-3.3	0.6	0.0	0.5	7.5	-0.6	0.3	-0.5	2.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

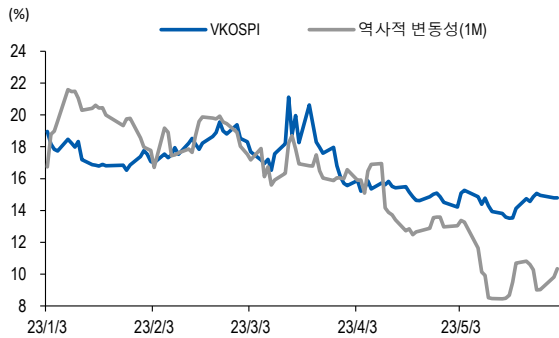
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	818,878	185.5	1,034,140	11.0%	지수옵션 전체	1,501,900	351.3	2,739,951
Put	683,022	165.8	1,705,811	12.8%	PCR(금액기준)	0.89	VKOSPI	14.80%(+0.01%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	350.0(K+3)	0.10	-0.31	126,053	37,975	-1,640	11.2	Put	345.0(K+1)	6.53	2.12	4,674	2,310	895	13.8
	347.5(K+2)	0.24	-0.57	157,961	32,405	2,777	11.0		342.5(K+0)	4.56	1.61	26,320	5,960	2,764	12.9
	345.0(K+1)	0.54	-0.94	170,858	33,558	4,568	10.9		340.0(K-1)	2.96	1.11	86,773	17,779	1,864	12.5
	342.5(K+0)	1.10	-1.35	126,437	33,944	2,285	10.9		337.5(K-2)	1.81	0.73	115,696	14,852	885	12.6
	340.0(K-1)	2.02	-1.85	39,584	32,137	593	10.8		335.0(K-3)	1.05	0.41	131,873	25,049	797	12.8

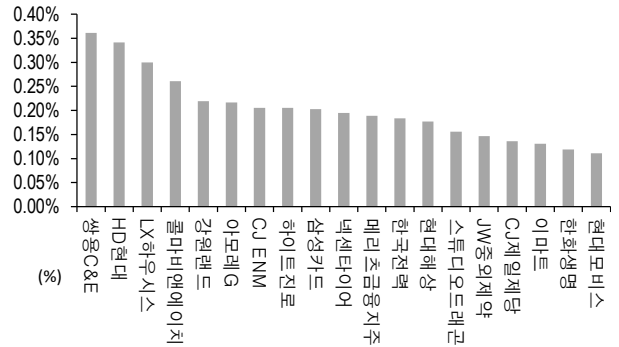
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	3,051,016	2,610.6	4,847,591	37,370	-12,051	15,857	-10,528	-28.0	24.9	0.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
영진약품	2,825	1.62	1.5	86.8	9,453	2,920	0.04%	7,247	165	-7,419	-7,419	0
DL 이앤씨	36,350	-1.36	4.5	66.9	6,188	-2,718	-0.06%	-230	-2,778	3,008	3,008	0
넥센타이어	8,290	-0.36	1.3	50.3	6,751	3,035	0.19%	3,633	-155	-3,479	-3,479	0
에코프로비엠	247,500	3.56	118.6	44.6	56,126	-1,276	-0.14%	-25	-984	1,085	199	0
SK 하이닉스	108,700	-1.63	379.1	44.2	250,507	2,480	-0.04%	-4,506	10,664	-6,910	-3,099	-1,873
SK 이노베이션	189,900	-1.30	56.5	43.8	16,518	-790	-0.01%	-2,631	295	2,329	1,881	605
와이지엔터	94,200	-0.95	22.0	40.5	32,682	703	0.04%	1,932	395	-2,569	-2,949	0
삼성전자	71,300	-1.38	687.5	39.7	1,214,939	8,473	-0.03%	-4,504	6,555	-5,103	961	-3,675
포스코퓨처엠	349,500	2.04	176.5	39.5	20,147	8	-0.05%	-550	-336	952	682	60
CJ CGV	15,660	-0.32	1.0	38.4	16,334	-1,740	0.01%	-1,405	-264	1,670	1,670	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터