

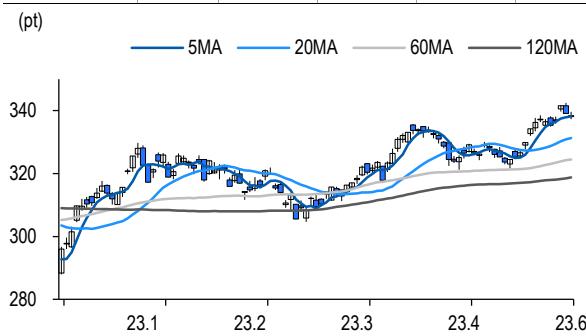


선물옵션시장 지표

2023.6.2

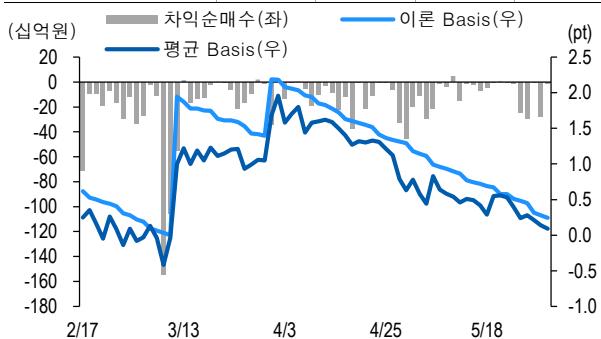
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	338.08	-0.31	-1.04	5,756.2	-
선물 6월물	338.05	-0.28	-0.95	18,308.0	308,679
선물 9월물	339.70	-0.29	-1.00	306.6	43,807
6월물(mini)	338.02	-0.29	-0.94	1,025.7	43,259
7월물(mini)	338.20	-0.21	-0.72	12.9	32,466



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.24	0.09	-0.03	-0.05%
베이시스(mini)	0.24	0.09	-0.06	-0.05%
제1스프레드(SP)	2.33	1.71	1.70	-0.18%
합성선물 베이시스(ATM)	0.24	-0.02	-0.02	-0.08%



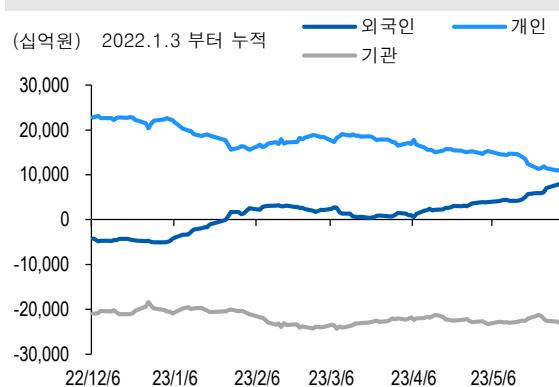
투자주체별 매매 동향

(십억원)

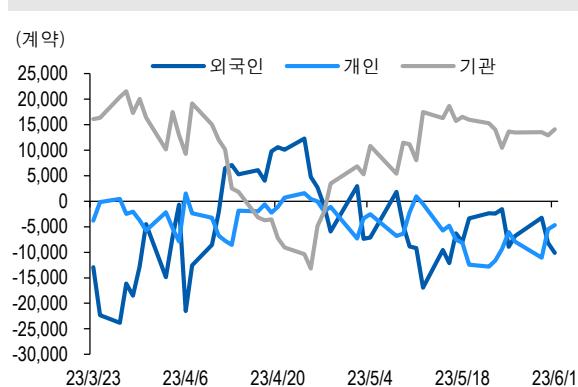
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	1.2	26.7	27.8	0.0	-88.0	-132.7	-30.1	-0.3	0.1	-19.8
개인	358.3	-2.3	355.9	0.0	0.0	68.6	3.8	1.0	0.3	39.3
기관	-384.5	-35.9	-420.4	-1.1	-76.1	79.3	24.9	-1.0	0.1	-21.7
금융투자	-152.0	-60.4	-212.5	-1.0	-1.3	93.2	25.5	-0.9	0.1	-29.8
투신	-65.0	1.2	-63.8	0.0	-17.0	-25.2	0.1	0.0	0.0	9.9
은행+보험+기타금융	-17.8	12.9	-4.8	0.0	-9.2	16.7	-0.7	0.0	0.0	0.3
연기금+국가지자체	-89.8	7.7	-82.1	0.0	-48.5	-5.3	0.0	0.0	0.0	-2.1
기타법인	25.1	3.5	28.5	0.0	-3.0	-15.2	1.4	0.3	-0.6	2.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	897,650	190.4	1,059,046	10.7%	지수옵션 전체	1,764,400	368.4	2,803,091						
Put	866,750	178.1	1,744,045	12.0%	PCR(금액기준)	0.94	VKOSPI	14.35%(-0.45%p)						
<hr/>														
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
	347.5(K+3)	0.13	-0.11	109,838	34,551	2,146	11.2	Put						
	345.0(K+2)	0.30	-0.24	193,322	36,243	2,685	10.8	342.5(K+1)	5.11	0.55	7,426	6,257	297	12.5
	342.5(K+1)	0.67	-0.43	207,163	35,239	1,295	10.6	340.0(K+0)	3.30	0.34	39,142	18,916	1,137	11.9
	340.0(K+0)	1.36	-0.66	174,899	33,894	1,757	10.4	337.5(K-1)	1.92	0.11	110,985	17,090	2,238	11.7
	337.5(K-1)	2.47	-0.85	47,463	26,288	2,126	10.1	335.0(K-2)	1.04	-0.01	168,374	27,638	2,589	11.8
	332.5(K-3)	0.52	-0.09	147,942	26,607	7,228	12.1							

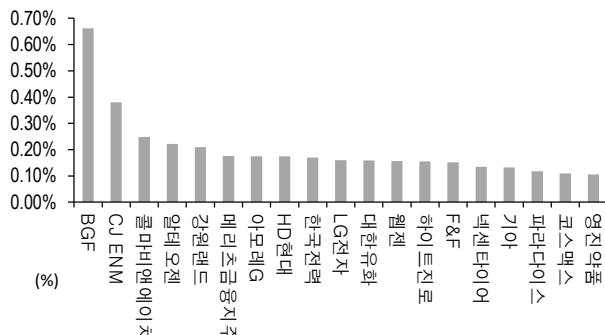
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	3,319,077	2,813.3	4,980,885	133,294	-56,260	66,454	-16,541	-19.8	39.3	-21.7	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	연기금등순매수
삼성전자	71,000	-0.42	739.1	71.5	1,155,034	-59,905	0.03%	12,694	38,536	-51,251	-55,317
SK 하이닉스	110,500	1.66	423.2	71.0	251,535	1,028	-0.04%	-1,643	1,878	-742	-2,167
삼성 SDI	707,000	-0.84	60.9	63.8	12,687	-145	-0.07%	-5	-74	80	162
코스맥스	81,300	2.01	2.7	61.4	2,541	-469	0.11%	-588	138	450	-776
에코프로비엠	250,000	1.01	99.1	60.0	56,504	378	-0.17%	-1,624	-552	2,145	2,187
포스코퓨처엠	359,500	2.86	180.8	59.9	20,543	396	-0.05%	206	-419	252	382
LG 전자	123,500	0.41	64.7	56.4	39,979	3,973	0.16%	1,164	2,813	-4,032	-3,812
현대차	197,800	-0.90	87.9	56.3	43,679	224	0.06%	940	1,313	-2,249	-1,987
SK 이노베이션	194,600	2.47	69.1	54.2	18,219	1,701	0.01%	880	496	-1,359	-769
영진약품	2,830	0.18	0.3	53.1	10,545	1,092	0.11%	546	38	-613	-613

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터