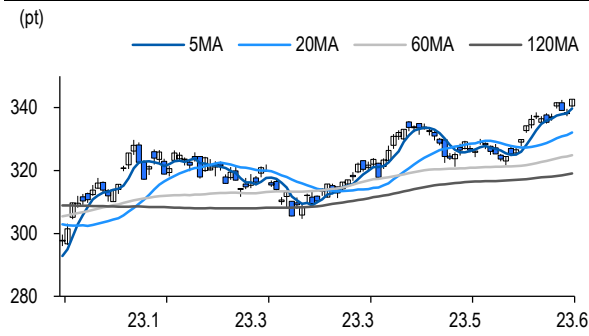


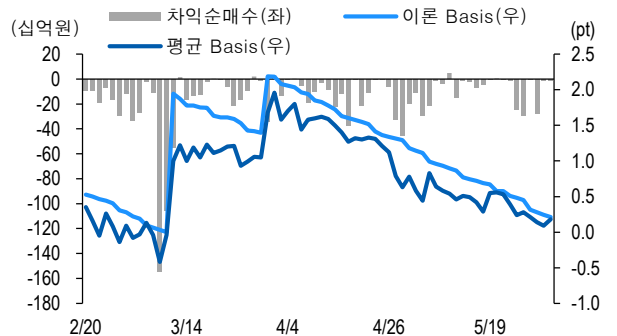
선물옵션시장 지표

2023.6.5

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	342.67	1.36	4.59	6,119.2	-
선물 6월물	342.95	1.45	4.90	14,716.3	266,012
선물 9월물	344.40	1.38	4.70	683.0	81,291
6월물(mini)	342.86	1.42	4.84	839.2	44,902
7월물(mini)	342.72	1.34	4.52	22.1	33,320

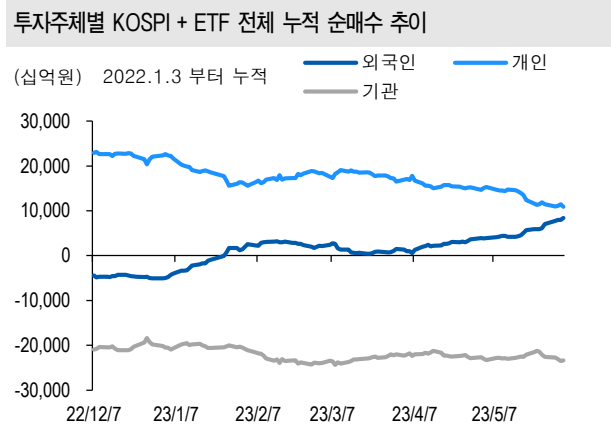


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.21	0.18	0.28	-0.01%
베이스스(mini)	0.21	0.18	0.19	-0.01%
제1스프레드(SP)	2.38	1.52	1.45	-0.25%
합성선물 베이스스(ATM)	0.21	0.27	0.27	0.02%

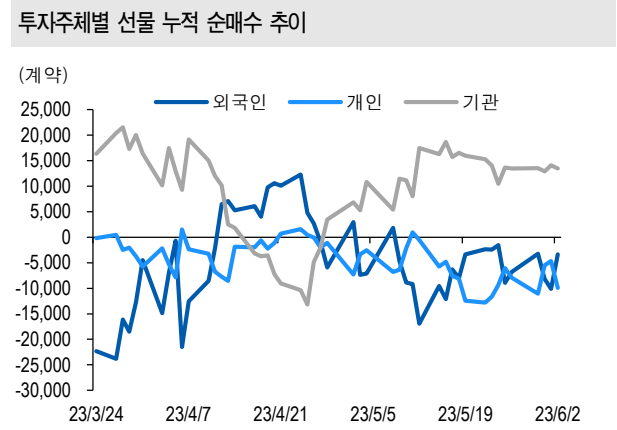


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	380.2	27.2	407.4	0.0	351.3	491.8	81.8	-7.9	0.2	17.2
개인	-572.1	56.0	-516.1	0.0	0.1	-417.5	-34.4	9.7	-2.2	30.5
기관	200.0	-100.7	99.3	-1.7	-28.6	-5.7	-46.9	-1.2	2.4	-50.2
금융투자	186.4	-101.7	84.8	0.0	12.9	-208.5	-47.1	-1.0	2.4	-42.3
투신	50.6	7.8	58.4	0.0	17.9	222.7	-0.4	-0.1	0.0	-4.7
은행+보험+기타금융	-16.5	-20.2	-36.7	0.0	-17.3	-19.8	0.6	-0.1	-0.1	0.0
연기금+국가자자체	-41.5	10.3	-31.3	0.0	-47.2	-0.1	0.0	0.0	0.0	-3.1
기타법인	-8.0	8.4	0.4	0.0	-0.1	-68.6	-0.5	-0.6	-0.4	2.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



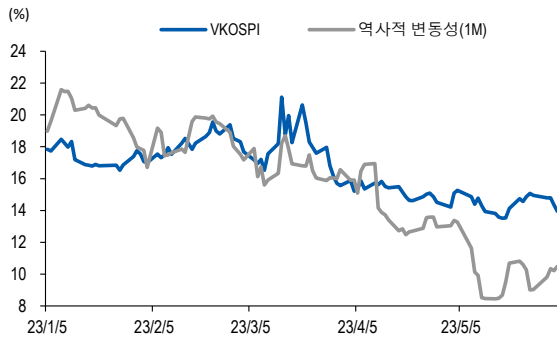
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,252,748	303.0	1,117,267	10.7%	지수옵션 전체	2,287,226	463.4	2,938,102
Put	1,034,478	160.4	1,820,835	11.4%	PCR(금액기준)	0.53	VKOSPI	13.96%(-0.39%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	345.0(K+3)	1.16	0.86	269,681	36,121	-122	10.7	Put	340.0(K+1)	0.86	-2.44	147,518	26,434	7,518	10.5
	342.5(K+2)	2.22	1.55	205,154	32,996	-2,243	10.6		337.5(K+0)	0.40	-1.52	207,184	26,894	9,804	11.0
	340.0(K+1)	3.81	2.45	93,220	30,260	-3,634	10.8		335.0(K-1)	0.17	-0.87	204,479	40,919	13,281	11.5
	337.5(K+0)	5.84	3.37	51,172	29,751	3,463	11.3		332.5(K-2)	0.07	-0.45	127,760	38,779	12,172	12.0
	335.0(K-1)	8.12	4.04	5,034	22,973	-274	12.1		330.0(K-3)	0.03	-0.22	91,114	48,043	9,361	12.7

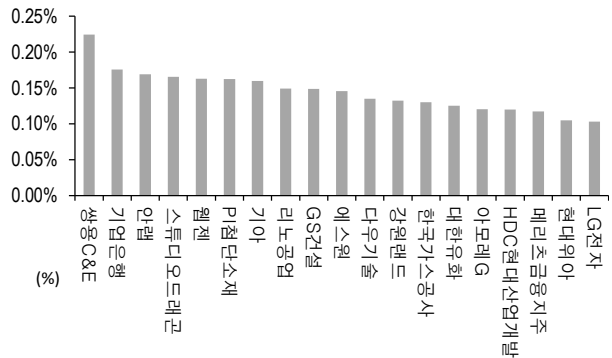
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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	2,717,487	2,580.8	5,019,228	38,343	42,880	49,322	-96,520	17.2	30.5	-50.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	110,700	0.18	278.5	71.6	230,390	-21,145	0.03%	2,758	16,330	-18,888	-7,665	-3,637
카카오	57,200	1.96	58.2	61.2	93,962	-5,094	0.06%	5,689	50,100	-55,794	-52,984	-2,990
포스코퓨처엠	375,000	4.31	317.1	58.4	19,928	-615	-0.01%	-292	-938	1,365	739	419
삼성전자	72,400	1.97	460.1	54.5	1,112,113	-42,921	-0.08%	-16,736	-29,613	41,288	35,049	3,339
에코프로비엠	255,500	2.20	94.8	50.3	52,454	-4,050	-0.09%	-1,082	344	725	-491	0
한국전력	19,330	-0.67	10.5	50.0	94,647	-22,803	-0.01%	-13,535	-935	15,007	10,352	4,553
SK 이노베이션	198,000	1.75	66.7	48.4	16,979	-1,240	0.07%	-126	-799	930	362	568
LG 전자	123,400	-0.08	53.9	47.8	42,061	2,082	0.10%	-1,030	3,072	-2,066	-5,132	2,416
현대차	199,600	0.91	39.5	47.7	40,860	-2,819	0.10%	1,310	-7	-1,284	-1,860	651
에스엠	101,700	0.30	18.7	41.2	36,713	-2,067	-0.23%	2,991	354	-3,346	-1,295	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터