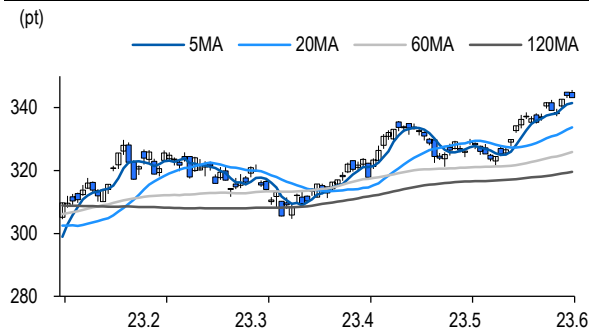


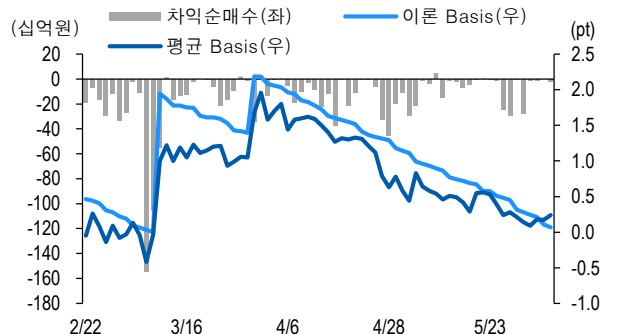
선물옵션시장 지표

2023.6.8

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	343.22	-0.20	-0.69	6,534.7	-
선물 6월물	343.25	-0.22	-0.75	14,265.5	144,557
선물 9월물	344.60	-0.26	-0.90	5,682.3	224,166
6월물(mini)	343.26	-0.22	-0.70	971.3	46,236
7월물(mini)	342.82	-0.28	-0.96	125.6	39,011

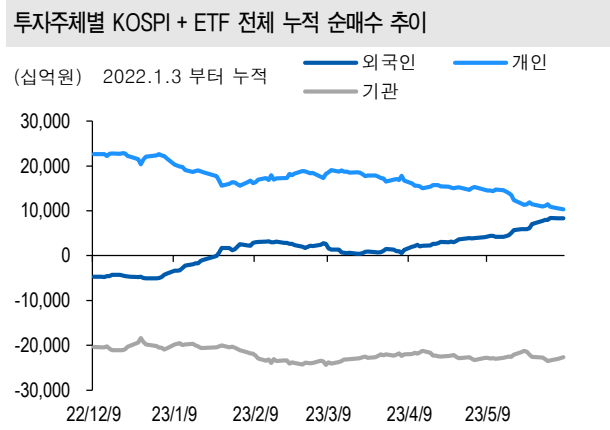


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.04	0.24	0.03	0.06%
베이스스(mini)	0.04	0.23	0.04	0.06%
제1스프레드(SP)	2.39	1.52	1.55	-0.25%
합성선물 베이스스(ATM)	0.04	0.04	0.04	0.00%

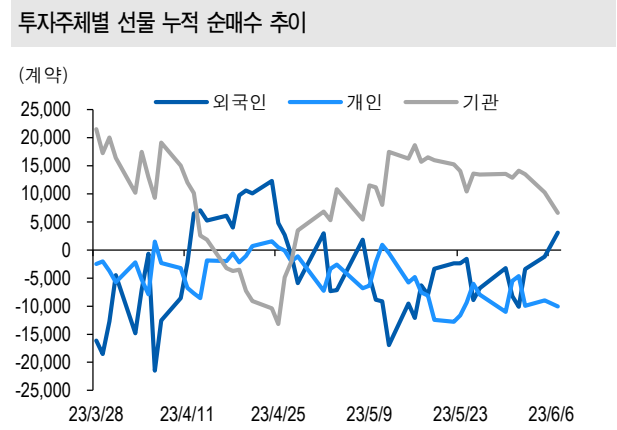


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-42.4	-4.2	-46.6	0.0	115.1	467.4	-91.4	9.1	5.4	-9.2
개인	-294.9	68.8	-226.1	0.0	-12.1	-108.3	12.6	-7.2	-5.3	14.6
기관	348.2	-43.0	305.2	-2.3	12.7	-398.7	78.3	0.8	2.0	-4.8
금융투자	402.9	-2.3	400.6	2.6	4.3	-241.0	74.6	0.8	2.5	-27.3
투신	-5.5	2.8	-2.7	0.0	19.9	-115.7	1.5	0.1	0.0	15.5
은행+보험+기타금융	-9.4	-56.3	-65.6	0.0	-10.4	-45.7	2.1	-0.1	-0.5	-0.7
연기금+국가자재	-27.2	12.7	-14.4	0.1	5.8	3.7	0.0	0.0	0.0	7.8
기타법인	-11.0	-22.0	-33.0	0.0	-0.7	39.6	0.6	-2.7	-2.1	-0.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



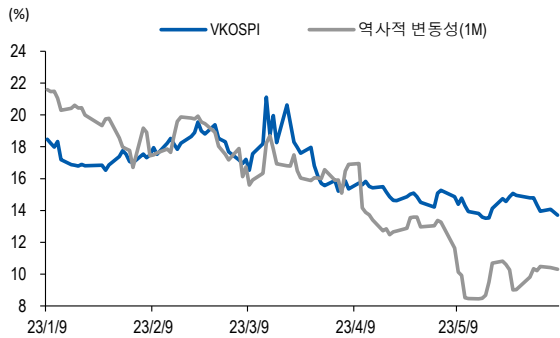
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,278,223	256.5	1,186,065	10.8%	지수옵션 전체	2,455,652	456.4	3,191,390
Put	1,177,429	199.9	2,005,325	10.8%	PCR(금액기준)	0.78	VKOSPI	13.71%(-0.37%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	352.5(K+3)	0.01	-0.02	68,405	38,036	2,063	14.8	Put	347.5(K+1)	4.29	0.32	42,573	5,588	3,354	11.0
	350.0(K+2)	0.02	-0.11	213,374	59,191	6,292	12.4		345.0(K+0)	2.13	-0.06	229,263	16,302	4,674	10.5
	347.5(K+1)	0.06	-0.36	444,309	51,255	16,852	10.2		342.5(K-1)	0.70	-0.29	378,205	27,281	5,373	10.4
	345.0(K+0)	0.39	-0.75	352,237	35,138	2,405	10.1		340.0(K-2)	0.17	-0.20	240,907	40,052	5,266	11.2
	342.5(K-1)	1.47	-0.97	100,722	31,165	1,685	10.1		337.5(K-3)	0.03	-0.09	62,110	46,360	-2,617	11.9

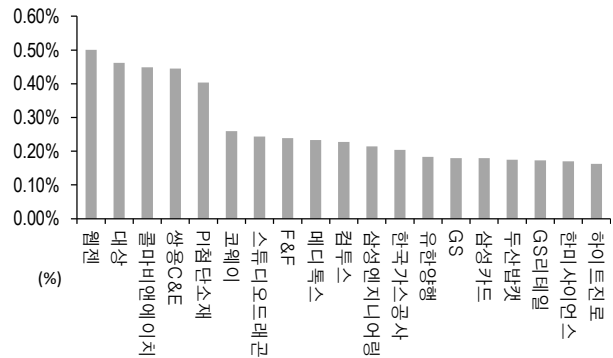
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,279,032	2,874.2	5,097,210	77,982	-6,136	29,302	-23,582	-9.2	14.6	-4.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
씨젠	24,750	1.23	4.6	73.6	47,558	-15,801	-0.05%	926	491	-1,417	-3,764	0
SK 하이닉스	108,300	-0.46	198.8	67.8	147,326	-60,163	0.06%	10,692	5,823	-16,724	-22,113	-657
한국전력	19,260	-1.48	14.4	59.3	48,719	-28,491	-0.06%	-14,749	3,243	10,648	10,861	-240
삼성전자	71,200	-0.56	606.5	57.8	539,300	-400,372	0.00%	13,290	5,602	-19,305	-22,045	1,200
포스코퓨처엠	384,500	0.92	193.0	55.5	7,476	-6,826	0.00%	155	-140	-15	-269	219
삼성전기	148,200	-0.07	16.9	51.4	8,553	-5,329	0.01%	61	-325	264	139	345
LG 전자	125,700	-1.18	54.0	49.1	31,794	-6,764	0.03%	-2,429	-679	3,069	2,655	524
LG 이노텍	301,500	-2.11	39.4	48.6	18,632	-2,172	0.10%	1,200	78	-1,303	-887	-138
LG 화학	744,000	2.90	106.2	48.2	3,645	-2,392	-0.02%	-974	33	954	714	240
롯데에너지	59,600	0.51	4.6	48.0	22,814	-8,380	0.06%	122	543	-661	-724	-232

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터