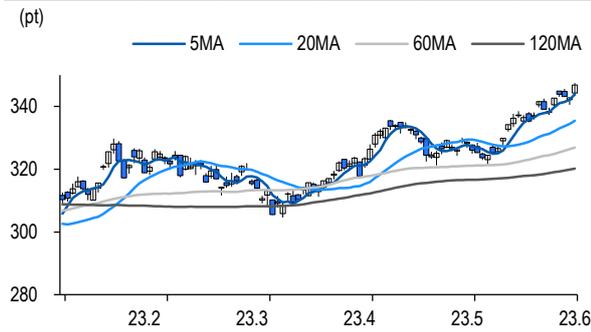


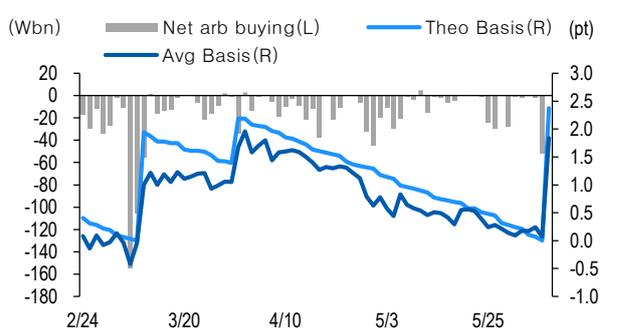
선물옵션시장 지표

2023.6.12

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	346.79	1.18	4.04	7,406.3	-
선물 9월물	349.50	1.47	5.05	17,991.1	274,260
선물 12월물	351.30	1.43	4.95	21.2	21,595
7월물(mini)	347.62	1.47	5.04	1,272.6	69,919
8월물(mini)	348.42	1.49	5.12	3.5	12,317

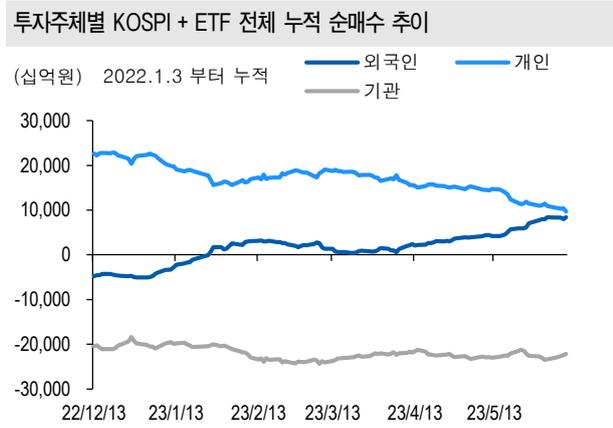


	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	2.38	1.84	2.71	-0.15%
베이스(mini)	0.14	0.08	0.83	-0.02%
제1스프레드(SP)	2.41	1.84	1.85	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	0.14	0.76	0.76	0.18%

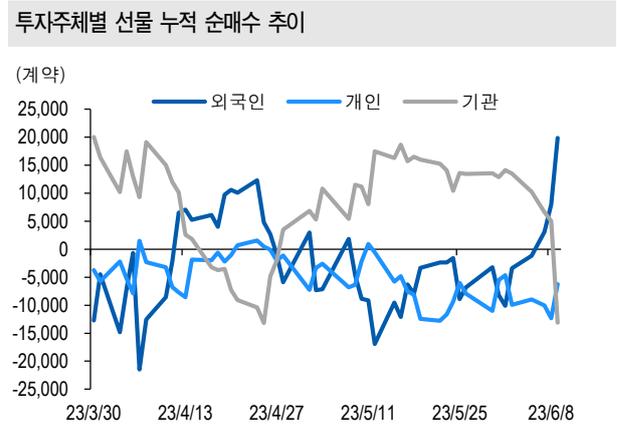


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	475.6	-1.7	473.9	0.0	199.6	253.5	55.8	-1.4	-5.4	-18.0
개인	-823.6	58.4	-765.2	0.0	-24.4	-495.0	-17.7	3.4	-6.5	82.6
기관	366.5	-74.7	291.9	-0.3	-10.9	218.2	-39.3	-1.7	12.7	-69.2
금융투자	281.2	-43.0	238.2	0.4	-1.1	-41.9	-42.6	-2.6	12.8	-54.0
투신	84.6	-8.2	76.4	0.0	64.5	259.4	3.0	-0.2	-0.1	8.6
은행+보험+기타금융	1.7	-19.0	-17.3	0.0	-3.3	1.8	0.3	1.0	0.0	0.0
연기금+국가자재	-2.9	-4.6	-7.5	-0.1	-57.8	-1.1	0.0	0.0	0.0	-23.8
기타법인	-18.5	0.0	-18.5	0.0	1.4	23.3	1.2	-0.3	-0.9	4.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	539,249	187.8	646,461	12.8%	지수옵션 전체	1,196,909	348.4	1,742,160
Put	657,660	160.6	1,095,699	12.4%	PCR(금액기준)	0.86	VKOSPI	13.16%(-0.28%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	350.0(K+3)	4.10	1.74	36,614	17,578	4,385	12.8	Put	345.0(K+1)	4.06	-2.45	8,224	4,563	2,391	11.7
	347.5(K+2)	5.29	2.17	13,872	8,127	1,069	13.0		342.5(K+0)	3.14	-2.08	14,897	3,993	1,776	11.9
	345.0(K+1)	6.60	2.50	11,161	9,158	1,960	13.1		340.0(K-1)	2.39	-1.76	25,667	11,461	2,929	12.1
	342.5(K+0)	8.19	2.91	4,691	3,814	184	13.4		337.5(K-2)	1.80	-1.44	32,939	9,641	4,819	12.4
	340.0(K-1)	9.77	2.98	1,097	5,473	221	13.3		335.0(K-3)	1.33	-1.19	59,750	13,062	5,487	12.6

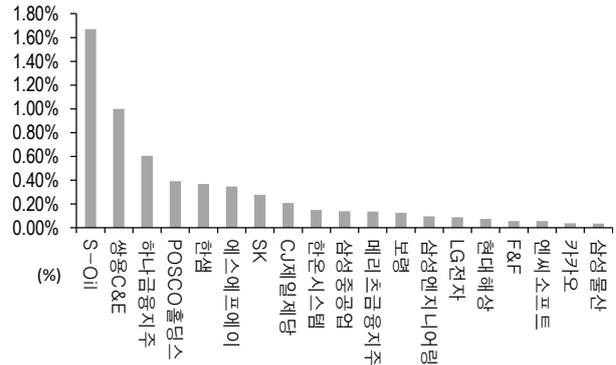
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,388,165	2,718.0	4,041,203	337,644	-55,259	133,168	-84,919	-18.0	82.6	-69.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
CJ CGV	14,800	-0.47	1.6	98.8	24,290	5,137	-2.18%	-1,957	-71	2,022	2,268	0
삼성전자	72,000	1.84	757.8	70.5	1,125,136	30,467	0.03%	-5,698	24,327	-19,153	-24,369	-7,502
농심	446,000	-1.11	5.5	69.6	665	55	-0.02%	4	53	-57	-57	0
삼성전기	147,600	1.44	25.9	69.5	12,959	1,686	-0.10%	2,006	-2,621	615	183	438
SK 하이닉스	115,200	5.69	525.6	65.4	167,560	13,405	-0.05%	-14,914	19,434	-5,276	-10,801	679
현대건설	39,350	0.13	9.0	60.9	7,987	2,458	-0.03%	-942	263	679	710	-31
SK	172,800	0.88	12.2	58.7	7,507	1,532	0.28%	935	125	-1,052	-1,256	-96
포스코퓨처엠	389,000	0.78	160.1	58.0	23,527	663	-0.09%	-244	561	-313	401	-640
LG 전자	127,100	-0.24	44.6	52.8	42,367	4,510	0.09%	1,864	1,720	-3,584	-4,266	596
LG 화학	756,000	2.16	87.4	49.5	7,670	579	-0.07%	110	-80	-37	147	-184

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터