

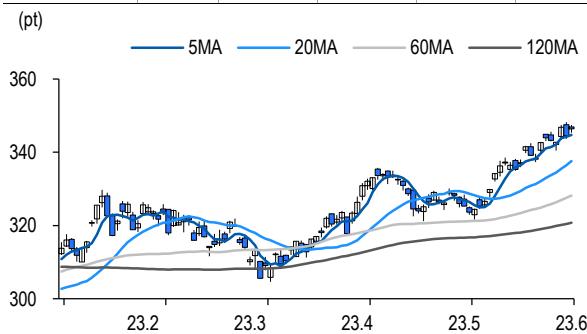


선물옵션시장 지표

2023.6.14

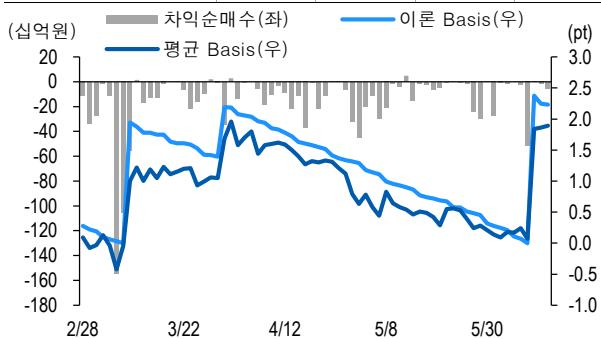
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	346.39	0.53	1.82	6,484.0	-
선물 9월물	348.40	0.50	1.75	17,038.3	277,710
선물 12월물	350.40	0.53	1.85	35.5	22,212
7월물(mini)	346.68	0.52	1.78	1,311.1	83,235
8월물(mini)	347.70	0.60	2.08	2.5	13,870



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.23	1.89	2.01	-0.10%
베이시스(mini)	-0.01	0.17	0.29	0.05%
제1스프레드(SP)	2.41	1.91	1.95	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.01	0.36	0.36	0.11%



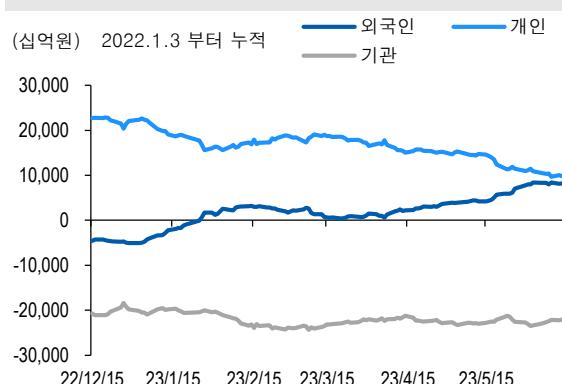
투자주체별 매매 동향

(십억원)

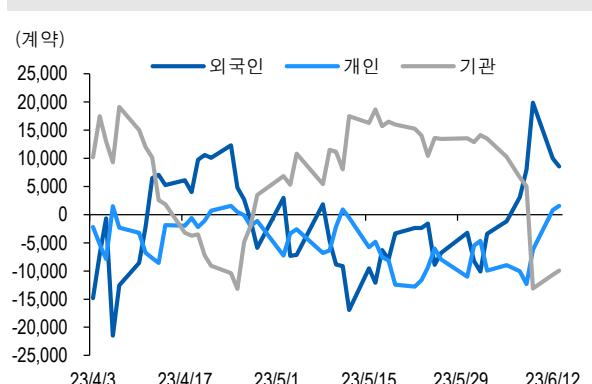
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	114.5	5.1	119.6	0.0	123.8	-14.0	-106.0	-11.5	-2.1	-2.8
개인	-249.2	9.1	-240.1	0.0	-31.4	92.1	-30.1	13.6	-2.0	10.3
기관	156.6	3.6	160.2	-5.3	-193.4	-76.2	135.7	-1.7	4.2	-7.2
금융투자	451.9	26.6	478.4	1.1	-1.3	-455.7	136.6	0.4	1.1	-18.3
투신	-10.8	2.7	-8.1	0.0	21.4	349.5	0.5	0.0	0.0	11.0
은행+보험+기타금융	-37.9	-76.0	-114.0	0.0	-12.3	49.3	-1.4	-2.0	3.1	0.8
연기금+국가지자체	-230.7	56.1	-174.5	0.0	-201.9	-19.3	0.0	0.0	0.0	-0.7
기타법인	-21.9	-7.6	-29.5	0.0	-2.4	-1.9	0.4	-0.4	-0.1	-0.3

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	513,950	193.5	742,146	13.0%	지수옵션 전체	915,648	330.5	1,933,100							
Put	401,698	137.0	1,190,954	12.9%	PCR(금액기준)	0.71	VKOSPI	13.76% (+0.31%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	352.5(K+3)	2.78	0.60	46,076	12,422	1,187	13.0	Put	347.5(K+1)	5.57	-0.88	6,442	4,148	1,651	12.5
	350.0(K+2)	3.69	0.74	21,674	17,065	584	13.1		345.0(K+0)	4.36	-0.77	10,058	6,757	1,619	12.6
	347.5(K+1)	4.76	0.91	31,223	20,344	11,791	13.1		342.5(K-1)	3.37	-0.63	20,009	5,731	605	12.8
	345.0(K+0)	6.11	1.17	6,888	9,729	104	13.4		340.0(K-2)	2.55	-0.51	36,991	16,520	1,811	12.9
	342.5(K-1)	7.70	1.28	950	3,969	14	13.8		337.5(K-3)	1.91	-0.40	39,602	12,067	1,441	13.1

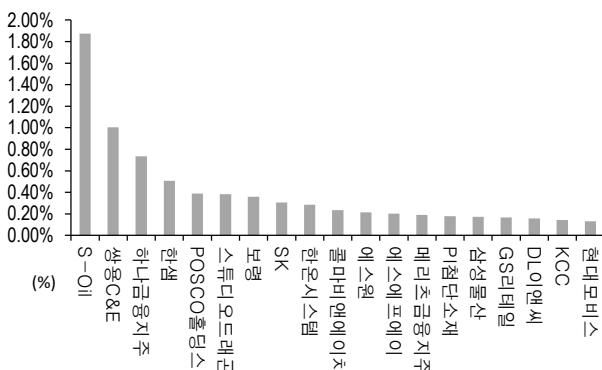
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)
주식선물 전체	3,060,823	2,516.3	4,283,409	126,233	-4,925	8,645	-1,953	-2.8	10.3	-7.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전기	149,300	1.01	33.9	91.1	13,098	545	-0.07%	-191	263	-56
CJ CGV	14,400	-0.35	1.4	80.8	34,083	5,125	-4.09%	2,935	-3,106	170
삼성전자	72,100	1.41	687.1	74.1	1,139,816	21,956	0.10%	6,839	2,089	-8,575
영원무역	49,750	-0.70	2.1	61.2	2,000	-144	-0.25%	522	72	-614
SK 하이닉스	119,100	3.93	400.5	57.0	184,252	10,821	-0.02%	714	-9,389	9,041
미래에셋증권	7,500	1.21	2.2	55.2	43,726	-1,591	-0.09%	3,614	-38	-3,576
포스코퓨처엠	395,000	1.15	196.4	53.5	24,375	-779	-0.07%	461	-297	-184
LG 화학	739,000	-1.47	58.9	51.3	7,973	-280	0.08%	-13	156	-152
한국항공우주	53,300	-1.11	10.9	49.5	11,745	-698	-0.01%	-1,109	-698	1,854
SK 이노베이션	201,000	-0.25	58.9	48.0	13,634	1,388	-0.01%	-583	198	386

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터