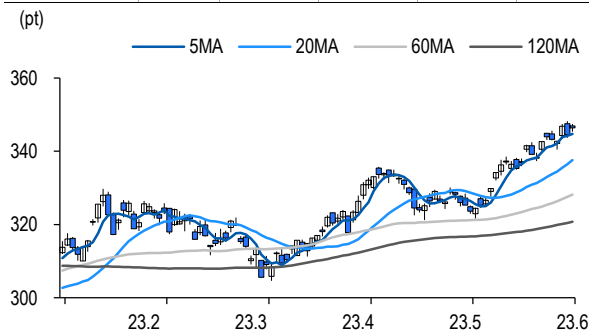


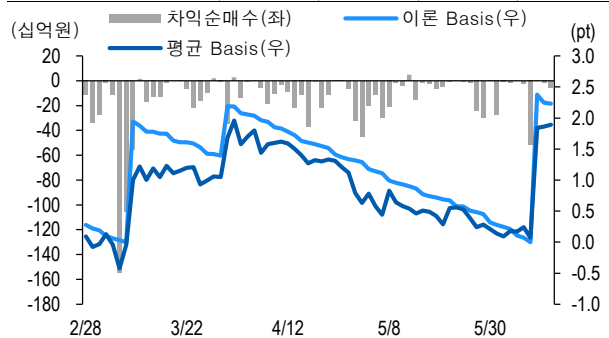
선물옵션시장 지표

2023.6.14

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(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



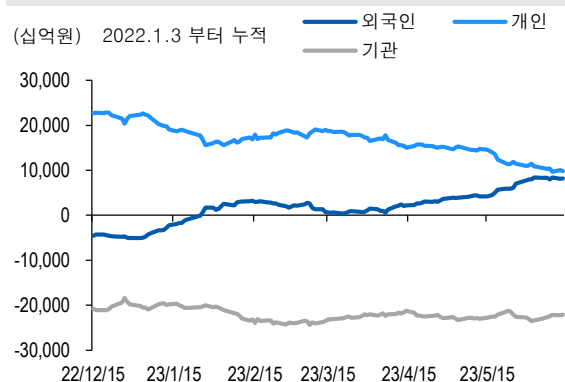
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	2.23	1.89	2.01	-0.10%
베이스(mini)	-0.01	0.17	0.29	0.05%
제1스프레드(SP)	2.41	1.91	1.95	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	-0.01	0.36	0.36	0.11%



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+국가자재	-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

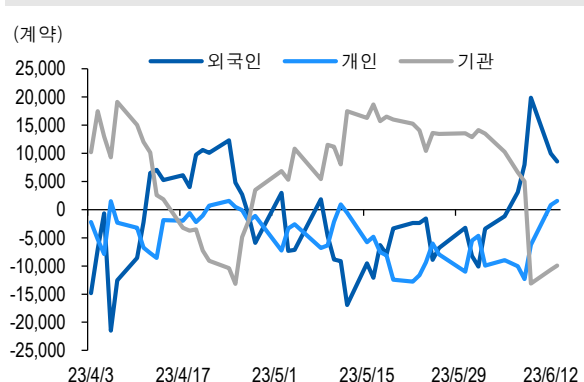
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향														(계약, 십억원)			
	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		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		

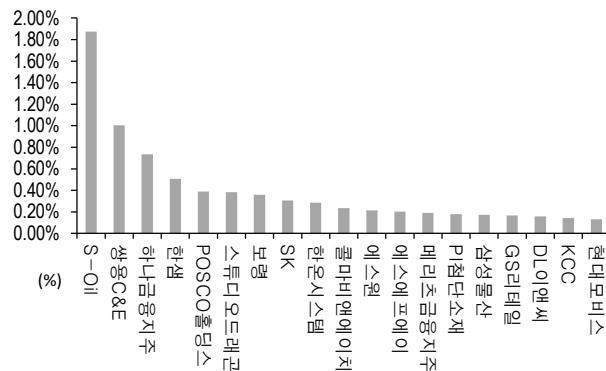
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 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 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전기	149,300	1.01	33.9	91.1	13,098	545	-0.07%	-191	263	-56	259	-395
CJ CGV	14,400	-0.35	1.4	80.8	34,083	5,125	-4.09%	2,935	-3,106	170	4,083	0
삼성전자	72,100	1.41	687.1	74.1	1,139,816	21,956	0.10%	6,839	2,089	-8,575	-19,521	100
영원무역	49,750	-0.70	2.1	61.2	2,000	-144	-0.25%	522	72	-614	-614	0
SK 하이닉스	119,100	3.93	400.5	57.0	184,252	10,821	-0.02%	714	-9,389	9,041	3,972	725
미래에셋증권	7,500	1.21	2.2	55.2	43,726	-1,591	-0.09%	3,614	-38	-3,576	-3,576	0
포스코퓨처엠	395,000	1.15	196.4	53.5	24,375	-779	-0.07%	461	-297	-184	308	-498
LG 화학	739,000	-1.47	58.9	51.3	7,973	-280	0.08%	-13	156	-152	-299	147
한국항공우주	53,300	-1.11	10.9	49.5	11,745	-698	-0.01%	-1,109	-698	1,854	452	1,402
SK 이노베이션	201,000	-0.25	58.9	48.0	13,634	1,388	-0.01%	-583	198	386	891	-605

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터