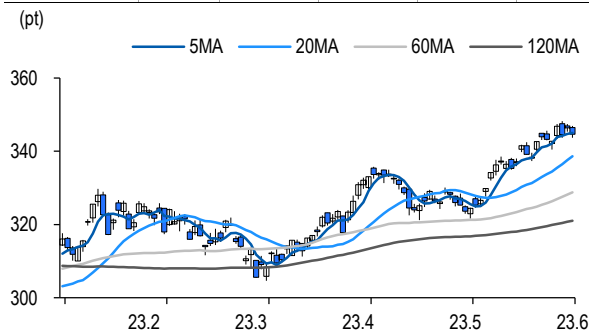


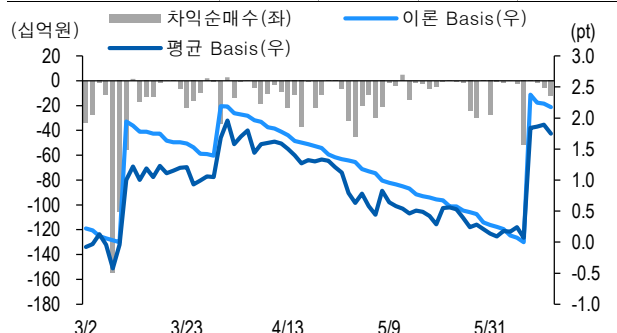
선물옵션시장 지표

2023.6.15

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	344.65	-0.50	-1.74	7,627.7	-
선물 9월물	346.40	-0.57	-2.00	18,639.4	280,077
선물 12월물	348.25	-0.61	-2.15	26.6	22,216
7월물(mini)	344.64	-0.59	-2.04	1,254.2	89,060
8월물(mini)	345.46	-0.64	-2.24	3.3	13,893



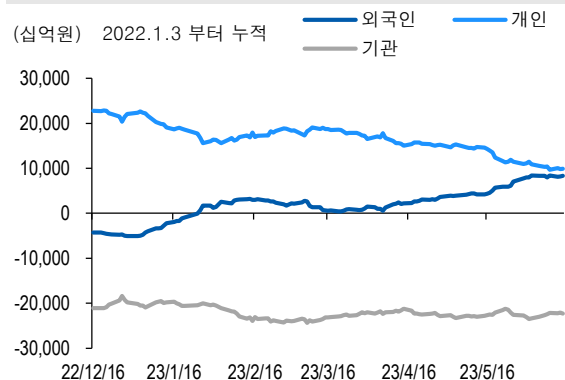
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	2.18	1.75	1.75	-0.12%
베이스(mini)	-0.05	0.00	-0.01	0.01%
제1스프레드(SP)	2.39	1.95	1.95	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	-0.05	-0.01	-0.01	0.01%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	112.9	11.4	124.3	0.0	20.6	362.8	-60.9	7.9	-1.4	12.6
개인	39.2	24.2	63.4	0.0	-6.9	31.6	28.2	-11.8	1.7	40.9
기관	-128.4	-102.3	-230.7	-12.4	-137.6	-429.9	31.7	3.6	-0.6	-53.1
금융투자	-4.5	-116.5	-121.0	-7.3	3.1	-54.5	29.8	3.8	-1.0	-51.9
투신	27.8	-7.6	20.3	0.0	26.2	-344.2	1.9	-0.1	0.0	-5.7
은행+보험+기타금융	-1.2	12.6	11.4	0.0	6.3	-2.4	0.0	0.0	0.4	0.1
연기금+국가자재	-167.9	2.0	-165.9	0.0	-177.3	-28.8	0.0	0.0	0.0	4.3
기타법인	-23.7	46.3	22.7	0.0	-0.4	35.4	1.0	0.3	0.2	-0.3

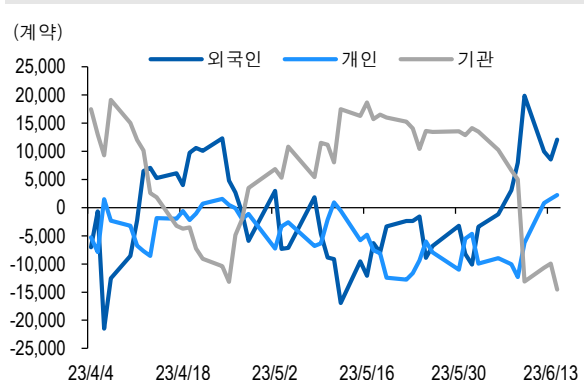
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



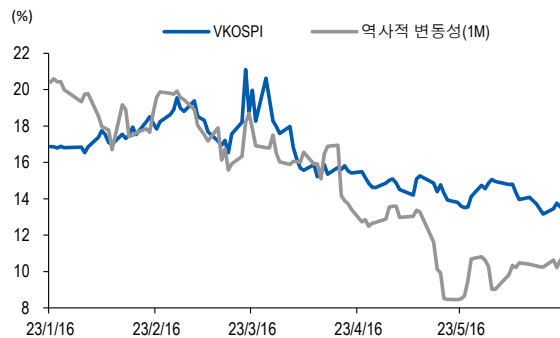
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	585,687	192.9	764,552	12.2%	지수옵션 전체	1,066,929	344.2	1,972,471
Put	481,242	151.3	1,207,919	12.7%	PCR(금액기준)	0.78	VKOSPI	13.55%(-0.21%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	355.0(K+3)	1.35	-0.70	80,625	22,164	402	12.2	Put	350.0(K+1)	8.01	1.06	1,163	2,570	226	12.3
	352.5(K+2)	1.91	-0.87	50,656	14,058	1,636	12.2		347.5(K+0)	6.44	0.87	4,897	3,963	-185	12.4
	350.0(K+1)	2.64	-1.05	42,230	18,519	1,454	12.2		345.0(K-1)	5.08	0.72	11,760	7,682	925	12.5
	347.5(K+0)	3.58	-1.18	34,316	11,383	-8,961	12.3		342.5(K-2)	3.95	0.58	15,890	6,240	509	12.6
	345.0(K-1)	4.71	-1.40	9,327	11,594	1,865	12.4		340.0(K-3)	3.03	0.48	42,352	16,323	-197	12.8

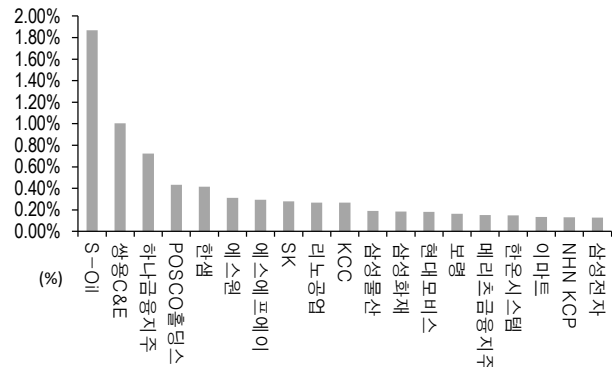
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	3,324,509	3,216.2	4,381,418	98,009	-24,284	63,511	-37,673	12.6	40.9	-53.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	71,800	-0.42	782.9	87.5	1,138,151	-1,665	0.13%	11,244	8,293	-19,895	-22,222	2,095
SK 하이닉스	118,800	-0.25	264.5	70.8	187,473	3,221	-0.02%	-1,661	2,902	1,721	-3,547	-1,710
CJ CGV	14,280	-0.83	1.1	61.4	36,147	2,064	-4.61%	33	-2,348	2,316	2,945	0
씨젠	23,800	-0.83	3.2	59.6	60,229	-3,591	-0.26%	21	-1,000	980	-3,514	0
삼성전기	147,300	-1.34	18.7	58.0	12,344	-754	-0.06%	-401	661	-250	-633	338
롯데에너지머티리얼즈	59,400	-3.41	7.9	55.3	40,402	2,199	0.01%	1,812	-529	-1,283	-1,799	477
영원무역	51,000	2.51	2.2	54.6	2,925	925	-0.20%	-504	935	-431	-431	0
LG 이노텍	306,500	-0.81	26.4	53.7	21,598	83	-0.01%	-39	240	-201	154	-355
포스코퓨처엠	373,000	-5.57	307.9	53.1	26,082	1,707	-0.05%	1,401	627	-1,928	-1,138	525
SK 이노베이션	193,200	-3.88	85.9	51.0	15,200	1,566	0.00%	3,100	-166	-2,948	-3,605	657

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터