

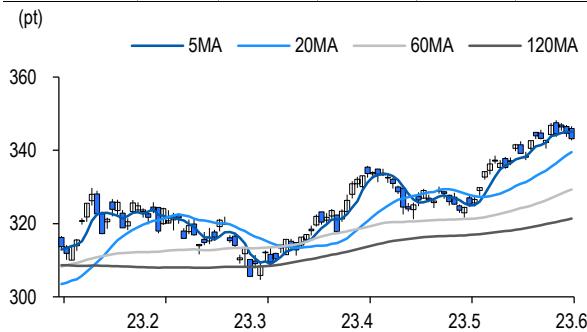


선물옵션시장 지표

2023.6.16

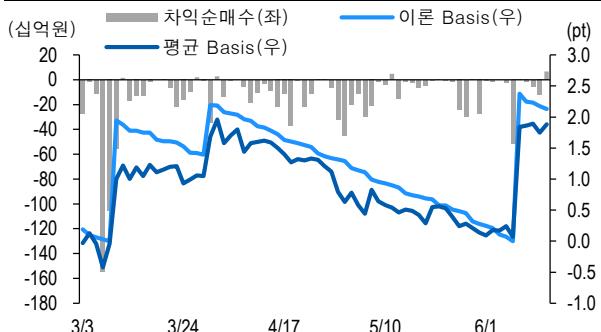
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	343.19	-0.42	-1.46	6,641.2	-
선물 9월물	345.15	-0.36	-1.25	20,475.2	276,777
선물 12월물	347.00	-0.36	-1.25	31.6	22,758
7월물(mini)	343.40	-0.36	-1.24	1,617.0	97,434
8월물(mini)	344.50	-0.28	-0.96	2.8	13,909



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.13	1.88	1.96	-0.07%
베이시스(mini)	-0.09	0.06	0.21	0.04%
제1스프레드(SP)	2.38	1.95	1.95	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.09	0.21	0.21	0.09%



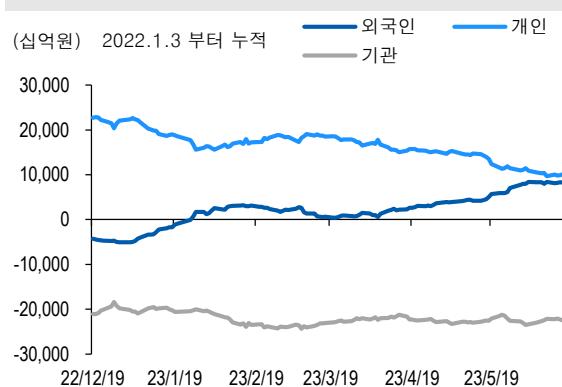
투자주체별 매매 동향

(십억원)

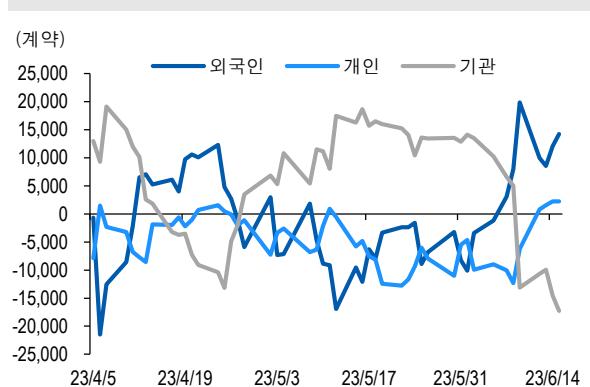
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-63.1	0.0	-63.1	0.0	60.8	286.9	-96.1	1.5	-0.7	7.0
개인	234.4	8.5	242.9	0.0	7.0	-3.7	3.2	0.0	-0.6	-22.8
기관	-186.8	-38.2	-225.0	6.6	-194.0	-329.5	93.2	-1.3	1.7	16.2
금융투자	79.4	-47.9	31.5	3.1	-0.1	-376.6	96.5	-0.4	0.4	29.9
투신	-14.8	-8.5	-23.3	1.7	8.0	43.1	-2.5	-0.2	0.0	-8.1
은행+보험+기타금융	-12.0	-2.8	-14.7	0.0	-2.8	29.3	-0.8	-0.8	1.3	0.0
연기금+국가지자체	-209.9	18.4	-191.5	0.1	-203.0	-25.3	0.0	0.0	0.0	-5.6
기타법인	15.5	17.3	32.8	0.0	1.0	46.3	-0.3	-0.2	-0.4	-0.4

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	664,320	191.6	789,675	12.1%	지수옵션 전체	1,195,841	368.6	2,028,532
Put	531,521	177.0	1,238,857	12.2%	PCR(금액기준)	0.92	VKOSPI	13.25%(-0.30%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	352.5(K+3)	1.44	-0.47	65,497	15,720	1,662	12.1	347.5(K+1)
	350.0(K+2)	2.04	-0.60	68,123	21,520	3,001	12.1	345.0(K+0)
	347.5(K+1)	2.91	-0.67	27,139	12,925	1,542	12.3	342.5(K-1)
	345.0(K+0)	3.90	-0.81	14,603	12,934	1,340	12.4	340.0(K-2)
	342.5(K-1)	5.10	-0.96	8,154	6,349	1,986	12.4	337.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	347.5(K+1)	7.02	0.58	3,126	4,049	86	11.7	345.0(K+0)
	345.0(K+0)	5.50	0.42	12,383	10,087	2,405	11.7	342.5(K-1)
	342.5(K-1)	4.26	0.31	21,885	8,498	2,258	11.9	340.0(K-2)
	340.0(K-2)	3.22	0.19	48,488	16,708	385	12.1	337.5(K-3)
	337.5(K-3)	2.39	0.14	49,995	13,125	391	12.3	

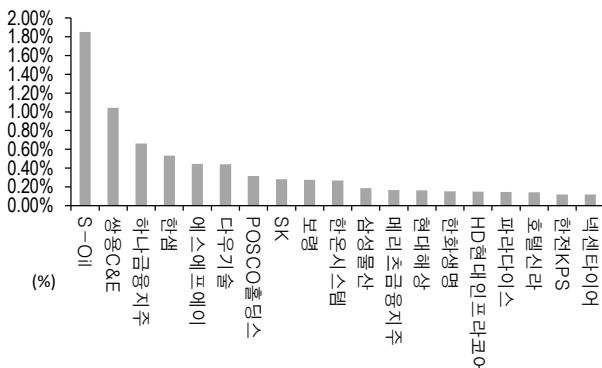
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,287,414	2,938.9	4,601,072	219,654	15,495	-12,411	-3,989	7.0	-22.8	16.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK 하이닉스	119,200	0.34	393.8	88.2	196,684	9,211	0.00%	2,673	-12,006	9,829
롯데에너지마티리얼즈	59,500	0.17	8.4	74.7	40,882	480	-0.03%	719	-5	-712
삼성전자	71,400	-0.56	662.2	70.2	1,173,185	35,034	0.09%	-785	-7,039	7,916
삼성전기	148,600	0.88	26.7	68.5	11,458	-886	-0.09%	72	-508	434
한국항공우주	52,700	-0.19	16.8	64.6	12,735	1,478	0.04%	2,849	-234	-2,615
포스코퓨처엠	375,500	0.67	271.3	64.4	25,028	-1,054	0.01%	695	-63	-729
에코프로비엠	259,000	1.97	234.2	63.8	59,193	1,334	-0.26%	1,472	-1,233	-48
SK 이노베이션	191,400	-0.93	77.1	62.0	15,461	261	-0.03%	246	-95	-152
현대차	199,100	-0.35	43.5	61.4	52,622	1,513	-0.10%	-1,040	1,350	-265
RFHIC	23,550	-1.46	2.1	53.4	27,997	449	-0.06%	1,702	-154	-1,547

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터