

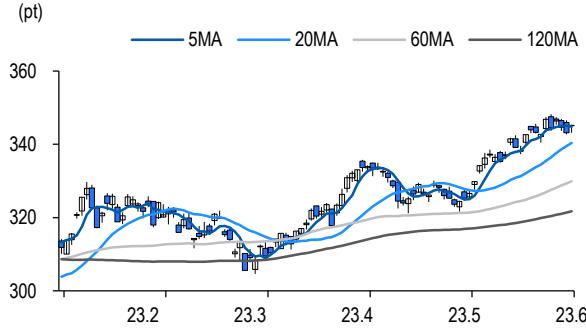


선물옵션시장 지표

2023.6.19

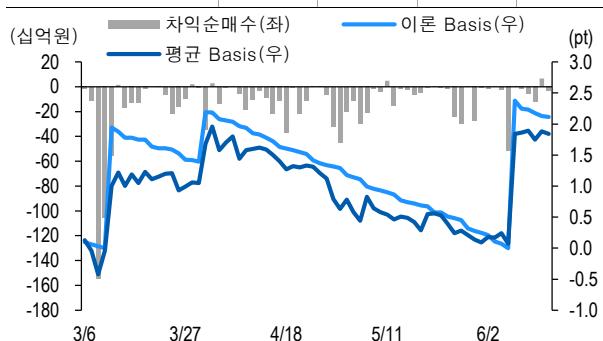
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	345.17	0.58	1.98	7,736.3	-
선물 9월물	347.30	0.62	2.15	18,668.1	273,793
선물 12월물	349.05	0.59	2.05	389.3	24,697
7월물(mini)	345.46	0.60	2.06	1,156.1	99,978
8월물(mini)	346.28	0.52	1.78	54.4	12,906



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.11	1.84	2.13	-0.08%
베이시스(mini)	-0.12	0.00	0.29	0.03%
제1스프레드(SP)	2.40	1.95	1.95	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.12	0.33	0.33	0.13%



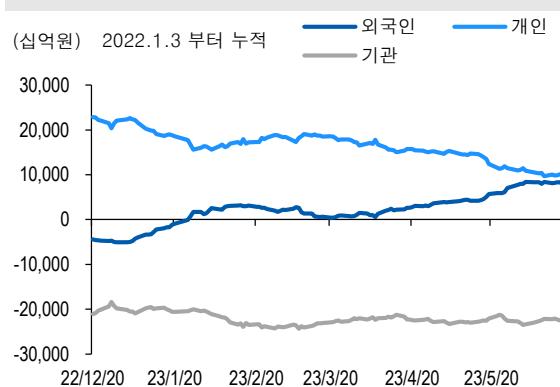
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	429.1	-17.0	412.2	-7.6	429.2	311.0	4.4	0.7	0.3	-8.2
개인	-208.7	-1.5	-210.2	0.0	-0.5	-261.5	-12.2	-1.0	0.2	13.5
기관	-214.4	11.2	-203.3	4.2	-129.4	22.9	9.3	0.7	-0.8	-5.7
금융투자	-121.6	91.5	-30.1	3.3	1.7	38.4	18.0	0.7	-0.8	-10.1
투신	6.4	-131.7	-125.3	0.0	10.4	-13.1	-10.0	0.0	0.0	1.8
은행+보험+기타금융	-6.4	51.0	44.6	0.0	-7.6	-3.8	1.3	0.0	0.0	0.3
연기금+국가지자체	-108.0	9.4	-98.6	0.0	-137.2	1.4	0.0	0.0	0.0	2.4
기타법인	-5.9	-3.5	-9.5	0.0	0.9	-72.5	-1.5	-0.4	0.4	0.4

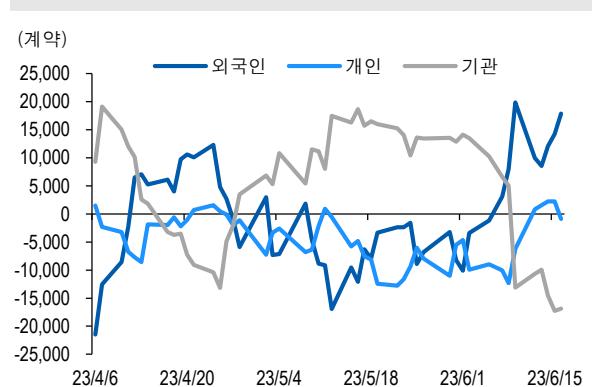
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	582,111	187.2	817,178	12.2%	지수옵션 전체	1,051,888	347.0	2,100,186
Put	469,777	159.9	1,283,008	12.0%	PCR(금액기준)	0.85	VKOSPI	13.13%(-0.12%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	350.0(K+3)	2.65	0.61	60,385	21,384	-136	12.3	345.0(K+1)
	347.5(K+2)	3.64	0.73	26,229	13,561	636	12.4	342.5(K+0)
	345.0(K+1)	4.84	0.94	13,212	13,594	660	12.6	340.0(K-1)
	342.5(K+0)	6.23	1.13	5,442	6,517	168	12.7	337.5(K-2)
	340.0(K-1)	7.89	1.34	1,507	6,125	141	13.1	335.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	345.0(K+1)	4.29	-1.21	8,875	11,169	1,082	11.4	
	342.5(K+0)	3.23	-1.03	15,524	9,672	1,174	11.6	
	340.0(K-1)	2.37	-0.85	38,449	17,120	412	11.8	
	337.5(K-2)	1.69	-0.70	51,778	14,977	1,852	12.0	
	335.0(K-3)	1.20	-0.55	50,243	17,715	-204	12.2	

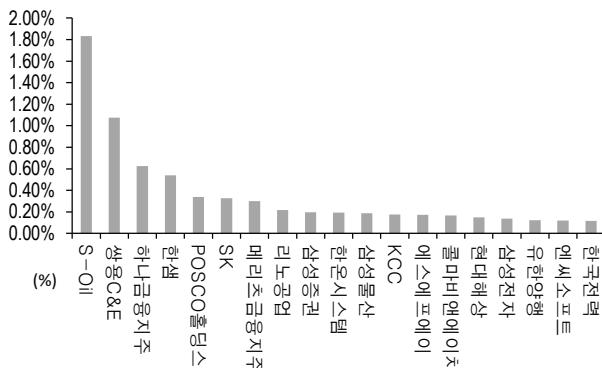
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,349,377	2,725.6	4,710,595	109,523	42,064	16,090	-59,238	-8.2	13.5	-5.7
<hr/>										
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
CJ CGV	12,600	-5.83	4.6	187.4	50,784	10,117	-11.55%	3,739	-761	-3,217
롯데케미칼	175,400	0.23	15.0	79.3	4,276	325	0.04%	662	-235	-427
SK 하이닉스	119,100	-0.08	389.3	76.6	202,285	5,601	0.02%	4,553	-1,464	-3,448
BGF	4,025	-1.47	0.3	73.5	6,610	-1,842	-0.42%	-458	-931	1,392
포스코퓨처엠	382,000	1.73	172.3	60.2	23,584	-1,444	-0.01%	313	-874	548
롯데에너지마티리얼즈	59,400	-0.17	7.5	60.0	42,067	1,185	0.04%	734	182	-915
LG 화학	745,000	2.62	157.7	59.7	9,106	1,067	0.01%	-333	249	75
삼성전자	71,600	0.28	637.4	58.0	1,179,772	6,587	0.14%	-17,018	-758	17,569
씨젠	23,700	1.50	3.2	57.6	59,741	-735	-0.49%	-358	-130	488
RFHIC	24,050	2.12	3.3	57.4	28,175	178	-0.11%	803	-93	-710

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터