

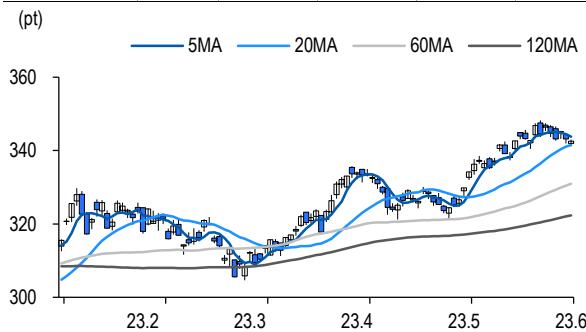


선물옵션시장 지표

2023.6.21

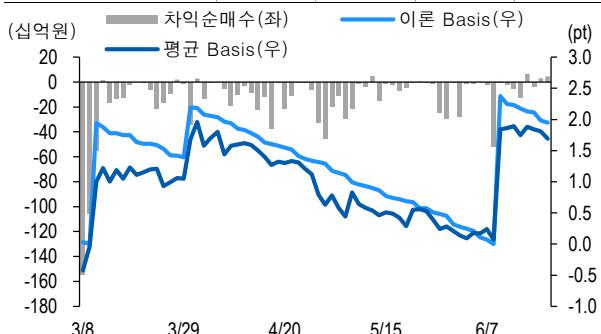
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	342.58	-0.16	-0.55	7,156.4	-
선물 9월물	344.15	-0.28	-0.95	14,947.0	276,494
선물 12월물	346.10	-0.26	-0.90	23.3	25,254
7월물(mini)	342.38	-0.26	-0.88	1,025.3	98,881
8월물(mini)	343.34	-0.19	-0.66	2.8	13,167



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.95	1.69	1.57	-0.07%
베이시스(mini)	-0.26	-0.13	-0.20	0.04%
제1스프레드(SP)	2.37	1.93	1.90	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.26	-0.23	-0.23	0.01%



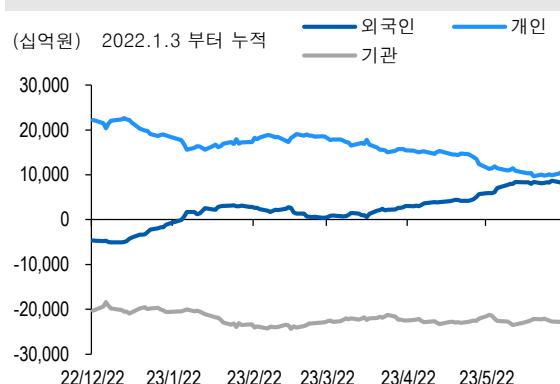
투자주체별 매매 동향

(십억원)

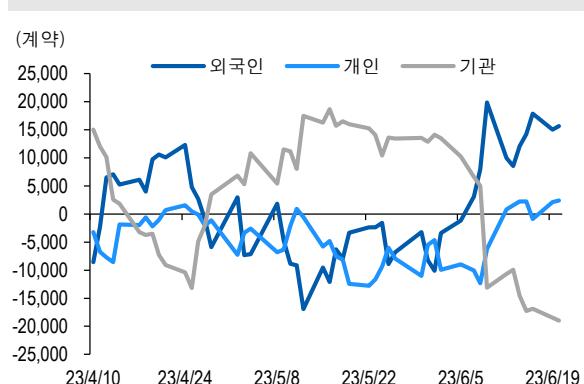
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-279.8	2.0	-277.8	0.0	-104.5	-58.7	108.5	1.6	-1.8	-15.3
개인	409.0	13.3	422.3	0.0	10.4	31.0	-5.1	-1.1	-0.1	1.7
기관	-135.2	16.0	-119.2	4.6	-138.0	56.9	-103.0	-0.3	1.8	12.5
금융투자	53.6	-21.2	32.5	0.1	0.5	135.0	-98.6	0.1	2.0	16.6
투신	-12.4	18.1	5.7	0.0	-8.2	-54.2	-4.3	-0.5	0.0	-2.3
은행+보험+기타금융	-8.2	33.3	25.1	0.0	-4.7	-4.8	0.0	0.0	-0.2	0.0
연기금+국가지자체	-92.5	-2.0	-94.5	0.0	-123.8	-19.0	0.0	0.0	0.0	-1.9
기타법인	6.0	-8.3	-2.3	0.0	0.8	-29.2	-0.5	-0.2	0.2	1.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

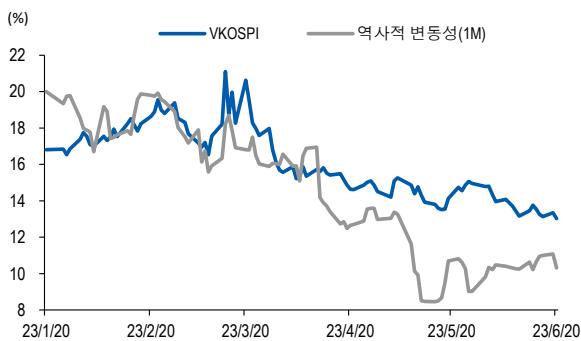
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	507,077	131.6	848,596	11.3%	지수옵션 전체	891,087	264.3	2,175,351							
Put	384,010	132.7	1,326,755	11.8%	PCR(금액기준)	1.01	VKOSPI	13.02%(-0.33%p)							
<hr/>															
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	350.0(K+3)	1.27	-0.40	74,218	23,430	619	11.2	Put	345.0(K+1)	5.45	0.27	3,960	12,160	-111	11.4
	347.5(K+2)	1.95	-0.43	57,274	15,715	659	11.4		342.5(K+0)	4.08	0.18	11,957	10,954	1,187	11.5
	345.0(K+1)	2.81	-0.58	36,588	14,942	731	11.4		340.0(K-1)	2.97	0.08	28,770	17,722	155	11.6
	342.5(K+0)	3.93	-0.73	14,685	8,992	1,879	11.4		337.5(K-2)	2.12	0.03	60,606	16,467	917	11.8
	340.0(K-1)	5.33	-0.77	4,749	6,681	513	11.6		335.0(K-3)	1.47	0.03	48,747	20,591	131	12.0

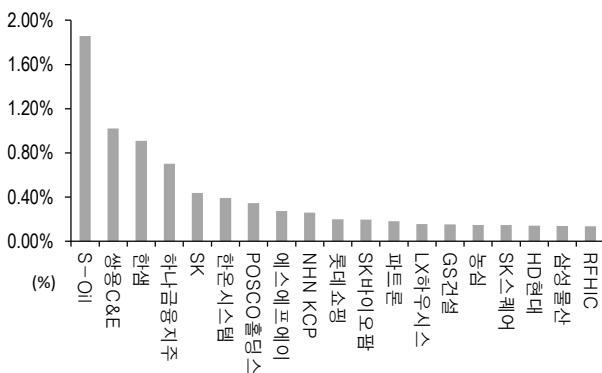
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,544,452	2,659.5	4,865,007	82,080	-45,746	10,073	34,601	-15.3	1.7	12.5
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	71,200	0.42	723.1	88.3	1,187,007	-2,791	0.09%	13,027	-21,645	8,690
SK 하이닉스	116,000	1.05	299.4	82.9	184,370	8,546	0.03%	5,840	4,597	-10,672
BGF	3,960	-0.13	0.3	82.9	6,155	31	-0.60%	2,932	-2,779	-153
롯데에너지	58,800	-1.18	6.1	76.8	42,252	191	0.07%	107	117	-249
아모레퍼시픽	104,000	-0.29	19.9	75.0	9,033	-246	-0.19%	-1,481	-96	1,577
웹젠	14,470	0.35	0.6	70.8	2,267	-1,537	-0.95%	887	-2,530	1,643
CJ CGV	12,510	-1.42	1.7	70.4	55,614	2,470	-12.42%	-1,271	2,024	-753
에코프로비엠	263,000	-1.68	121.8	68.2	63,502	2,789	-0.23%	-3,381	-201	3,266
현대건설	39,700	-0.75	11.4	67.7	17,047	2,897	-0.04%	2,461	112	-2,583
SK	163,200	-0.55	15.3	65.3	15,997	2,061	0.44%	-541	1,848	-1,307

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터