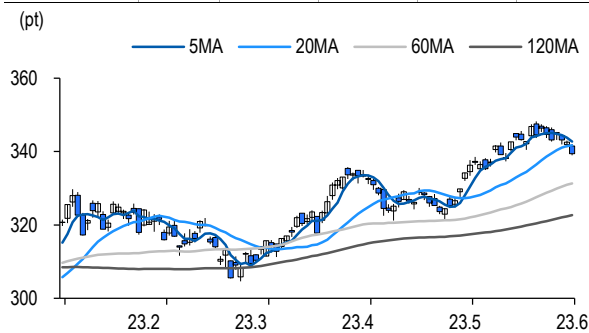


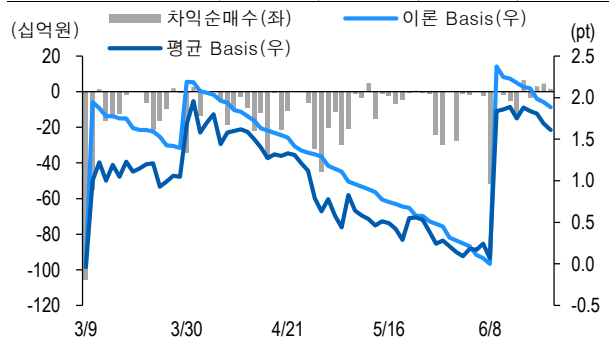
선물옵션시장 지표

2023.6.22

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	339.44	-0.92	-3.14	6,569.0	-
선물 9월물	341.15	-0.87	-3.00	16,206.8	284,863
선물 12월물	342.95	-0.91	-3.15	23.9	25,932
7월물(mini)	339.44	-0.86	-2.94	1,334.8	94,588
8월물(mini)	339.98	-0.98	-3.36	1.9	13,213



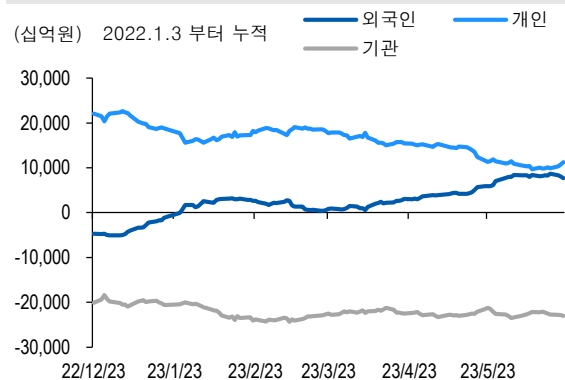
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.88	1.61	1.71	-0.08%
베이스(mini)	-0.31	-0.13	0.00	0.05%
제1스프레드(SP)	2.34	1.86	1.85	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	-0.31	-0.02	-0.02	0.08%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-402.9	43.5	-359.5	0.0	-211.7	-883.9	249.8	-12.5	-0.4	-14.2
개인	624.1	-82.6	541.5	0.0	10.9	349.3	18.2	12.3	-0.9	14.0
기관	-207.8	89.0	-118.8	1.6	-81.6	558.7	-268.3	0.1	1.6	-5.0
금융투자	43.2	86.5	129.7	-0.1	-2.9	671.8	-283.9	0.3	1.2	-0.3
투신	-35.0	-5.9	-40.9	0.0	-18.5	-80.4	15.8	-0.2	0.0	-5.9
은행+보험+기타금융	-15.2	37.9	22.7	0.0	-11.1	-14.7	-0.2	0.0	0.4	0.1
연기금+국가지자체	-136.6	-29.5	-166.1	1.7	-49.2	-18.0	0.0	0.0	0.0	1.1
기타법인	-13.4	13.4	0.0	0.0	-0.6	-24.1	0.3	0.1	-0.3	5.2

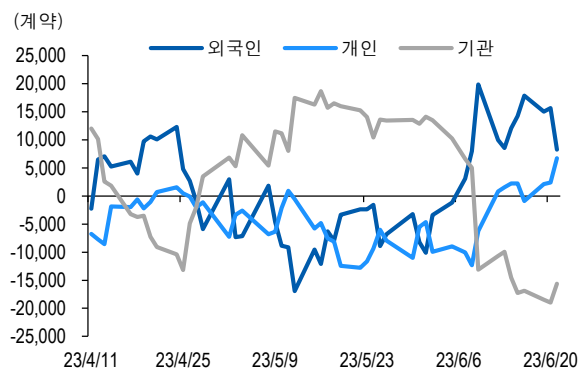
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



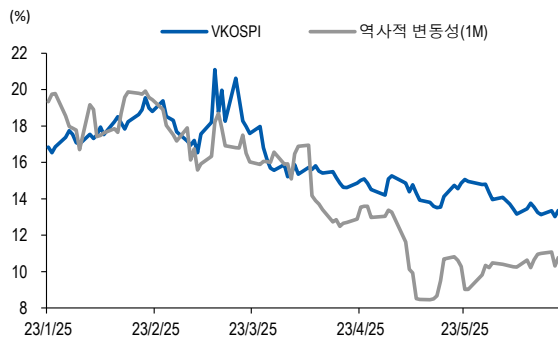
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	528,784	136.3	892,432	11.8%	지수옵션 전체	960,679	275.4	2,251,274
Put	431,895	139.0	1,358,842	11.8%	PCR(금액기준)	1.02	VKOSPI	13.36%(+0.34%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	350.0(K+3)	0.74	-0.53	81,784	24,535	1,105	11.7	Put	345.0(K+1)	7.37	1.92	2,222	12,017	-143	11.0
	347.5(K+2)	1.17	-0.78	61,401	19,276	3,561	11.8		342.5(K+0)	5.71	1.63	9,030	11,431	477	11.2
	345.0(K+1)	1.76	-1.05	43,886	18,082	3,140	11.7		340.0(K-1)	4.30	1.33	22,358	18,829	1,107	11.4
	342.5(K+0)	2.63	-1.30	20,150	11,021	2,029	12.0		337.5(K-2)	3.14	1.02	40,433	17,351	884	11.6
	340.0(K-1)	3.74	-1.59	27,090	17,766	11,085	12.2		335.0(K-3)	2.28	0.81	54,666	21,947	1,356	12.0

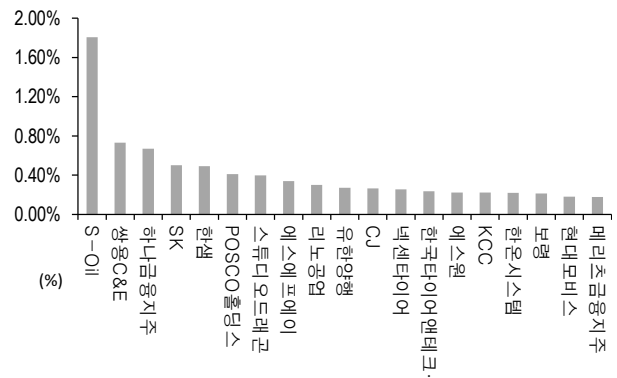
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,179,954	2,433.8	4,927,210	62,203	6,323	10,961	-22,872	-14.2	14.0	-5.0		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	115,100	-0.78	264.9	84.4	186,240	1,870	0.02%	-9,244	772	5,896	2,808	-3
포스코퓨처엠	374,500	0.27	156.5	79.1	27,051	1,152	-0.05%	-398	-661	1,062	770	51
삼성전자	70,400	-1.12	531.7	71.4	1,186,668	-339	0.06%	-3,980	26,855	-23,227	-7,010	1,313
대한유화	150,600	-3.09	6.1	64.7	3,969	87	-0.64%	1	-163	162	162	0
에코프로비엠	262,000	-0.38	115.9	62.7	66,385	2,883	-0.24%	-965	942	-54	43	0
한화에어로	139,800	-1.89	132.0	59.3	20,467	951	0.01%	1,216	3,783	-4,999	-3,698	-1,294
LG 전자	125,300	1.21	61.5	59.3	43,458	972	0.04%	1,000	-201	-1,027	-651	-376
미래에셋증권	7,410	2.07	2.7	58.2	43,603	-2,581	-0.11%	5,786	-2,056	-3,729	-3,729	0
롯데케미칼	179,200	-4.12	12.6	58.1	4,350	-395	-0.02%	-442	-31	473	192	283
한국전력	18,650	-0.85	12.5	57.9	88,195	6,105	0.12%	10,574	-1,940	-8,633	-7,849	-784

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터