

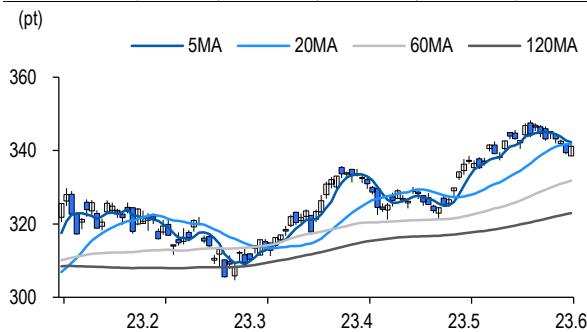


## 선물옵션시장 지표

2023.6.23

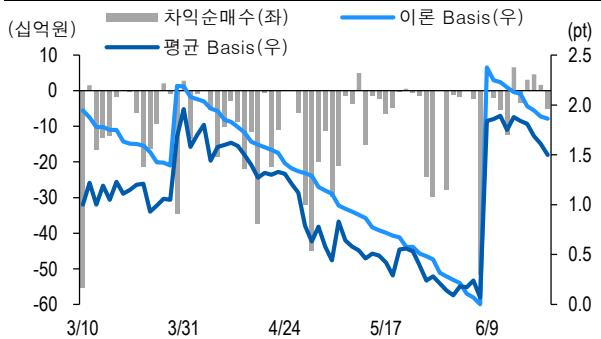
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	341.12	0.49	1.68	5,779.9	-
선물 9월물	342.25	0.32	1.10	15,670.5	280,669
선물 12월물	344.05	0.32	1.10	18.5	25,908
7월물(mini)	340.52	0.32	1.08	1,574.5	99,987
8월물(mini)	341.04	0.31	1.06	54.7	14,234



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.86	1.50	1.13	-0.11%
베이시스(mini)	-0.34	-0.26	-0.60	0.02%
제1스프레드(SP)	2.35	1.85	1.85	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.34	-0.61	-0.61	-0.08%



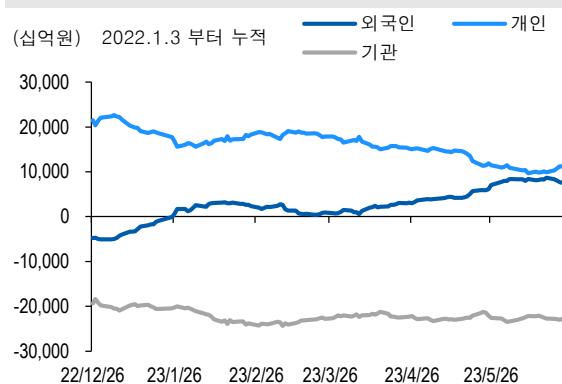
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

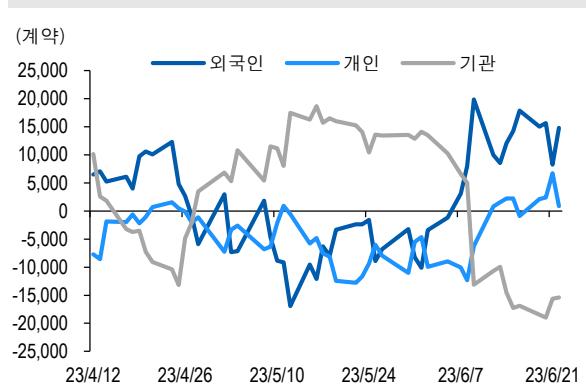
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-109.5	-7.5	-117.0	0.0	65.6	684.1	-124.9	2.5	-1.4	11.9
개인	-105.6	-9.3	-114.8	0.0	-1.4	-460.8	-40.0	-2.7	2.3	-7.3
기관	214.1	-5.2	208.9	-5.0	31.2	-145.3	165.5	0.9	-1.4	-3.3
금융투자	79.0	-115.4	-36.3	-1.6	-3.7	-436.0	158.0	0.9	-1.4	-7.2
투신	13.4	79.4	92.8	0.0	-5.7	325.5	8.4	0.0	0.0	-0.5
은행+보험+기타금융	-30.5	30.3	-0.2	0.0	-9.6	-8.1	-0.9	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	140.4	-2.4	138.0	-1.7	55.2	-26.7	0.0	0.0	0.0	4.4
기타법인	1.0	21.5	22.5	0.0	1.0	-78.1	-0.6	-0.7	0.6	-1.2

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	603,855	168.3	905,734	11.0%	지수옵션 전체	1,089,145	325.1	2,287,689
Put	485,290	156.7	1,381,955	12.5%	PCR(금액기준)	0.93	VKOSPI	13.24%(-0.12%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	347.5(K+3)	1.31	0.14	107,480	20,668	1,392	11.1	342.5(K+1)
	345.0(K+2)	2.00	0.24	76,786	20,537	2,455	11.1	340.0(K+0)
	342.5(K+1)	2.95	0.32	30,599	12,275	1,254	11.2	337.5(K-1)
	340.0(K+0)	4.14	0.40	18,877	19,950	2,184	11.2	335.0(K-2)
	337.5(K-1)	5.61	0.54	2,679	2,983	252	11.2	332.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	342.5(K+1)	4.93	-0.78	5,952	11,433	2	12.1	340.0(K+0)
	340.0(K+0)	3.63	-0.67	24,187	21,187	2,358	12.1	337.5(K-1)
	337.5(K-1)	2.62	-0.52	28,486	17,657	306	12.3	335.0(K-2)
	335.0(K-2)	1.83	-0.45	66,165	23,184	1,237	12.4	332.5(K-3)
	332.5(K-3)	1.26	-0.31	62,999	15,633	105	12.6	

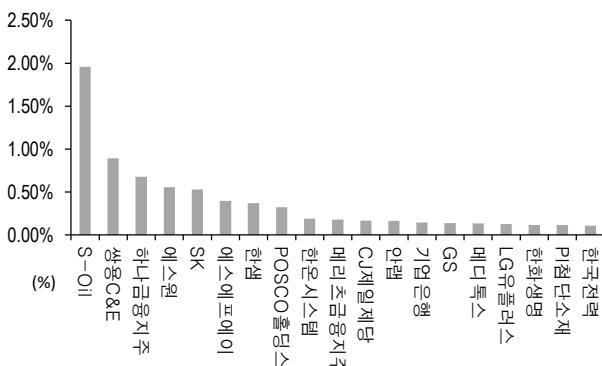
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	3,067,553	2,339.2	4,905,818	-21,392	-2,024	-42,336	44,066	11.9	-7.3	-3.3
<hr/>										
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
포스코퓨처엠	377,500	0.80	168.2	87.4	26,164	-887	0.00%	579	515	-1,099
롯데케미칼	179,500	0.17	14.6	75.6	4,945	595	0.02%	800	-204	-596
롯데에너지	57,100	0.18	7.5	74.2	41,580	100	-0.09%	1,793	-2,184	391
에코프로비엠	265,500	1.34	100.4	72.0	63,924	-2,461	-0.17%	1,435	-51	-1,335
LG 전자	125,600	0.24	38.2	71.2	43,854	396	-0.02%	463	958	-1,421
삼성전자	71,100	0.99	568.4	70.0	1,171,636	-15,032	-0.06%	-2,616	-20,426	23,410
SK 이노베이션	183,500	0.88	48.7	68.1	17,134	-532	-0.07%	-1,214	-43	1,257
한화에어로	138,500	-0.93	88.0	66.5	18,577	-1,890	0.04%	-1,807	1,660	147
SK 하이닉스	113,800	-1.13	197.2	66.1	191,534	5,294	0.05%	-3,158	2,626	412
현대차	201,000	-1.23	45.5	57.5	55,593	618	-0.06%	-835	1,351	-526

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터