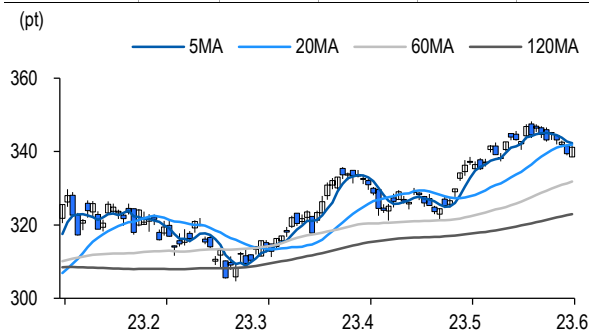


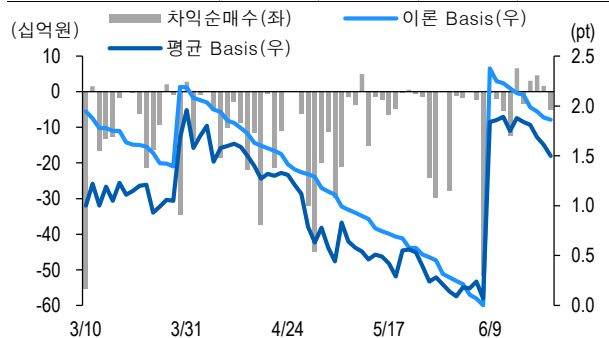
선물옵션시장 지표

2023.6.23

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(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



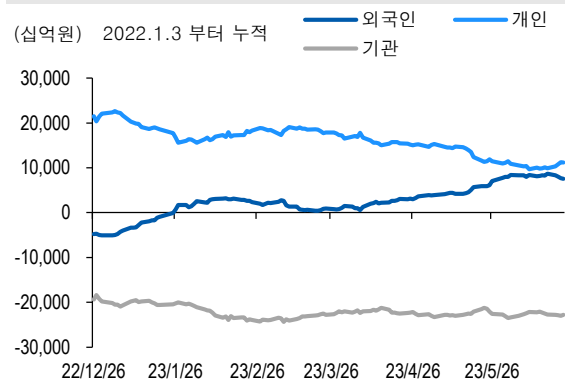
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.86	1.50	1.13	-0.11%
베이스(mini)	-0.34	-0.26	-0.60	0.02%
제1스프레드(SP)	2.35	1.85	1.85	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	-0.34	-0.61	-0.61	-0.08%



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+국가자재	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

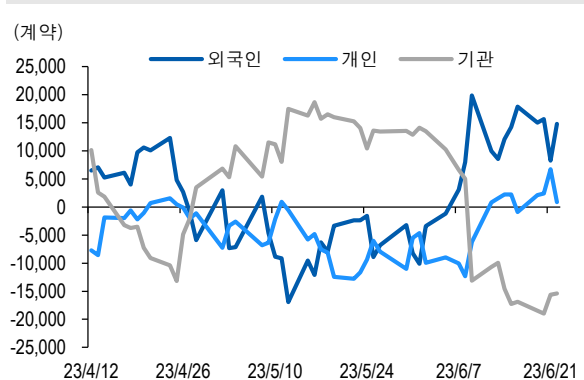
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



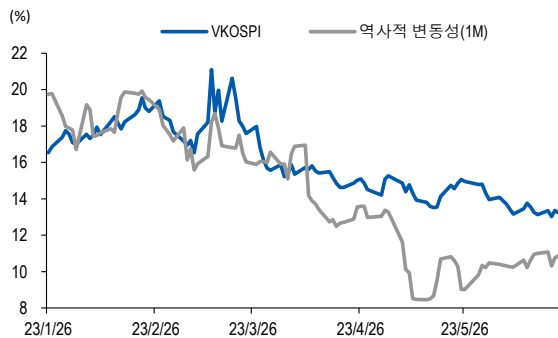
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	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)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		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	Put	342.5(K+1)	4.93	-0.78	5,952	11,433	2	12.1
	345.0(K+2)	2.00	0.24	76,786	20,537	2,455	11.1		340.0(K+0)	3.63	-0.67	24,187	21,187	2,358	12.1
	342.5(K+1)	2.95	0.32	30,599	12,275	1,254	11.2		337.5(K-1)	2.62	-0.52	28,486	17,657	306	12.3
	340.0(K+0)	4.14	0.40	18,877	19,950	2,184	11.2		335.0(K-2)	1.83	-0.45	66,165	23,184	1,237	12.4
	337.5(K-1)	5.61	0.54	2,679	2,983	252	11.2		332.5(K-3)	1.26	-0.31	62,999	15,633	105	12.6

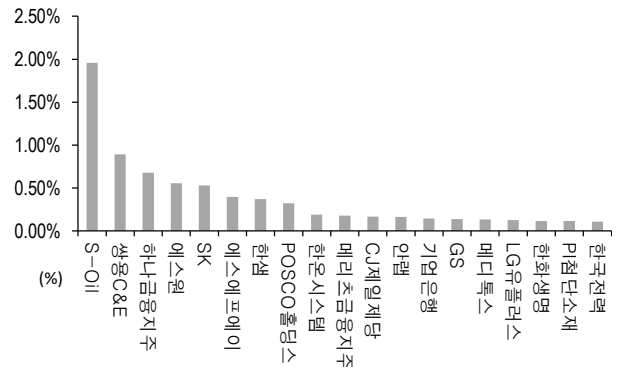
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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	3,067,553	2,339.2	4,905,818	-21,392	-2,024	-42,336	44,066	11.9	-7.3	-3.3	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
포스코퓨처엠	377,500	0.80	168.2	87.4	26,164	-887	0.00%	579	515	-1,099	-997	-301
롯데케미칼	179,500	0.17	14.6	75.6	4,945	595	0.02%	800	-204	-596	-360	-236
롯데에너지	57,100	0.18	7.5	74.2	41,580	100	-0.09%	1,793	-2,184	391	331	60
에코프로비엠	265,500	1.34	100.4	72.0	63,924	-2,461	-0.17%	1,435	-51	-1,335	-1,439	0
LG 전자	125,600	0.24	38.2	71.2	43,854	396	-0.02%	463	958	-1,421	-699	-276
삼성전자	71,100	0.99	568.4	70.0	1,171,636	-15,032	-0.06%	-2,616	-20,426	23,410	21,703	5,223
SK 이노베이션	183,500	0.88	48.7	68.1	17,134	-532	-0.07%	-1,214	-43	1,257	1,066	191
한화에너지	138,500	-0.93	88.0	66.5	18,577	-1,890	0.04%	-1,807	1,660	147	-1,338	1,486
SK 하이닉스	113,800	-1.13	197.2	66.1	191,534	5,294	0.05%	-3,158	2,626	412	3,275	-913
현대차	201,000	-1.23	45.5	57.5	55,593	618	-0.06%	-835	1,351	-526	-257	-267

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터