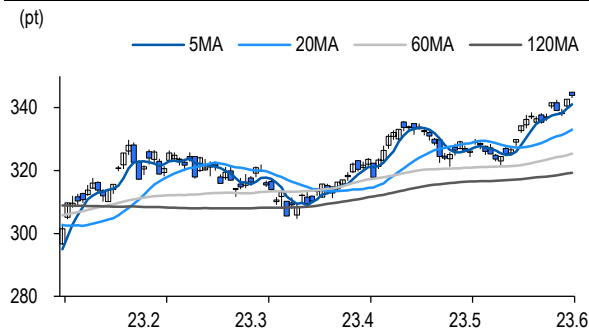


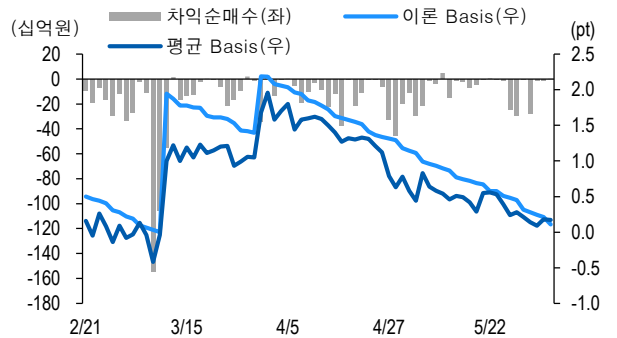
선물옵션시장 지표

2023.6.7

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	343.91	0.36	1.24	5,779.9	-
선물 6월물	344.00	0.31	1.05	14,059.0	224,727
선물 9월물	345.50	0.32	1.10	1,491.4	152,681
6월물(mini)	343.96	0.29	1.10	783.6	45,176
7월물(mini)	343.78	0.31	1.06	49.7	36,339

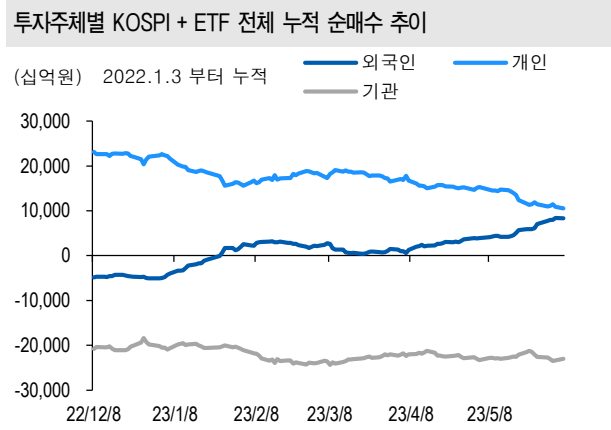


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.11	0.17	0.09	0.02%
베이스스(mini)	0.11	0.17	0.05	0.02%
제1스프레드(SP)	2.39	1.48	1.45	-0.26%
합성선물 베이스스(ATM)	0.11	0.04	0.04	-0.02%

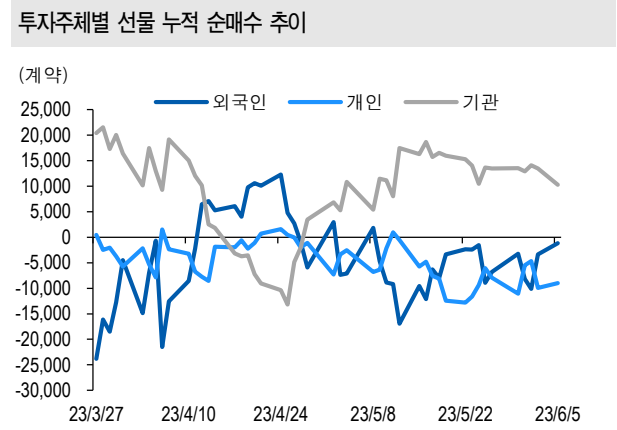


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-23.0	-14.5	-37.4	0.0	-37.3	213.0	-22.5	10.6	-0.5	19.6
개인	-434.1	53.3	-380.9	0.0	0.3	70.1	13.9	-7.9	-2.7	17.8
기관	452.8	-53.2	399.6	0.2	8.1	-286.1	8.2	-2.8	3.8	-38.6
금융투자	299.5	18.4	317.9	0.3	5.0	-166.8	8.9	-1.9	4.0	-31.4
투신	39.6	-27.8	11.8	0.0	-2.7	-59.7	0.0	-1.9	0.0	-5.5
은행+보험+기타금융	16.7	-38.0	-21.3	0.0	0.8	-55.5	-0.7	1.0	-0.2	-0.5
연기금+국가자재	32.9	-4.2	28.7	0.1	3.4	-4.1	0.0	0.0	0.0	-1.2
기타법인	4.3	15.5	19.7	0.0	1.3	3.0	0.3	0.1	-0.6	1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

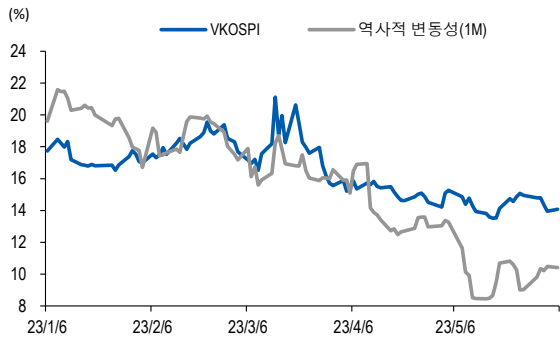
지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,284,385	268.4	1,137,181	10.9%	지수옵션 전체	2,431,512	444.9	3,048,901
Put	1,147,127	176.5	1,911,720	12.0%	PCR(금액기준)	0.66	VKOSPI	14.08%(+0.12%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	350.0(K+3)	0.13	-0.09	262,032	52,899	3,274	11.2	Put	345.0(K+1)	2.19	-1.01	88,045	11,628	7,548	11.6
	347.5(K+2)	0.42	-0.11	299,927	34,403	-385	10.9		342.5(K+0)	0.99	-0.78	214,461	21,908	10,697	11.5
	345.0(K+1)	1.14	-0.02	229,089	32,733	-3,388	10.9		340.0(K-1)	0.37	-0.49	313,735	34,786	8,352	11.7
	342.5(K+0)	2.44	0.22	87,276	29,480	-3,516	10.8		337.5(K-2)	0.12	-0.28	199,698	48,977	22,083	12.1
	340.0(K-1)	4.30	0.49	16,738	28,030	-2,230	10.3		335.0(K-3)	0.05	-0.12	108,277	42,686	1,767	13.3

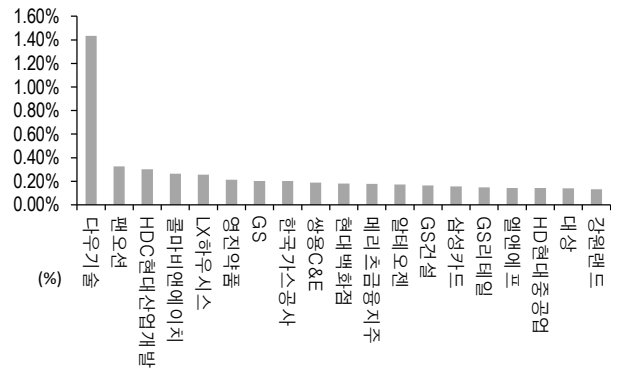
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,279,032	2,874.2	5,097,210	77,982	82,630	19,230	-103,018	19.6	17.8	-38.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	71,600	-1.10	639.9	70.5	939,672	-172,441	-0.02%	7,517	3,373	-12,301	4,841	-2,036
SK 하이닉스	108,800	-1.72	232.8	69.1	207,489	-22,901	0.03%	1,420	2,477	-4,305	-4,811	1,324
LG 전자	127,200	3.08	156.3	64.3	38,558	-3,503	0.11%	989	-192	-887	-4,272	-1,076
LG 이노텍	308,000	-0.81	31.3	58.2	20,804	-353	0.05%	375	8	-383	71	-454
포스코퓨처엠	381,000	1.60	260.1	56.2	14,302	-5,626	-0.04%	367	-786	426	737	-15
롯데에너지	59,300	1.37	4.2	54.3	31,194	-3,956	0.04%	-1,069	757	313	149	164
씨젠	24,450	0.00	2.4	52.1	63,359	-3,329	-0.34%	251	-302	51	3,051	0
LG 화학	723,000	0.42	55.5	51.9	6,037	-1,919	-0.04%	-972	9	967	1,065	-98
삼성 SDI	716,000	-0.14	28.8	51.9	12,317	-224	-0.03%	-526	163	370	98	272
한국전력	19,550	1.14	9.2	51.9	77,210	-17,437	-0.02%	-8,760	1,558	7,202	6,998	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터