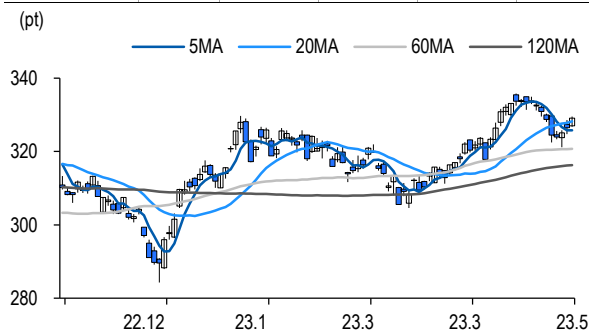


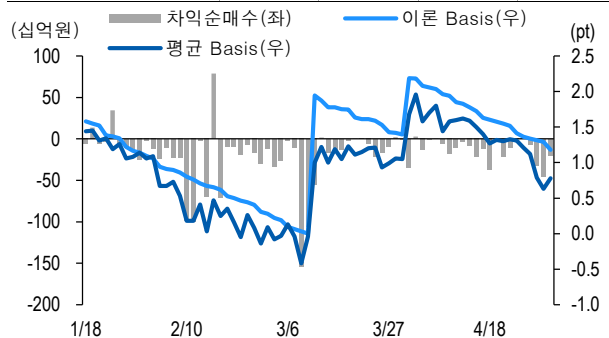
선물옵션시장 지표

2023.5.3

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	329.09	0.81	2.63	6,226.2	-
선물 6월물	330.00	1.10	3.60	18,148.6	321,283
선물 9월물	331.65	1.14	3.75	30.2	23,691
5월물(mini)	329.36	1.09	3.54	1,680.6	72,974
6월물(mini)	330.10	1.13	3.62	8.9	9,757



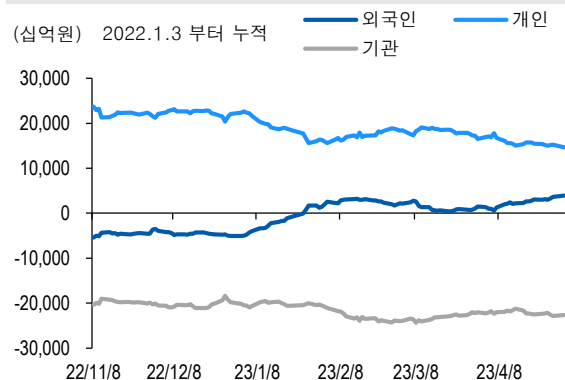
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.18	0.78	0.91	-0.12%
베이스(mini)	0.29	0.14	0.27	-0.04%
제1스프레드(SP)	2.03	1.52	1.55	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	0.29	0.21	0.21	-0.02%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	341.8	-2.3	339.5	0.0	166.7	994.8	-263.7	-1.6	-0.4	6.6
개인	-552.0	-13.4	-565.3	0.0	3.5	-490.7	-15.8	0.0	-0.2	-41.3
기관	228.5	16.3	244.8	-20.0	-14.6	-407.9	279.0	1.7	1.0	35.8
금융투자	191.9	32.6	224.6	-15.1	-3.0	-484.9	275.9	-0.1	1.1	32.9
투신	1.2	-9.0	-7.8	0.0	-1.0	102.1	2.1	0.0	0.0	2.2
은행+보험+기타금융	5.8	-6.2	-0.4	0.0	-4.5	-9.8	1.0	1.8	0.0	-0.3
연기금+국가자재	20.2	-1.2	19.1	0.0	-9.0	-15.3	0.0	0.0	0.0	0.9
기타법인	-18.4	-3.7	-22.0	0.0	0.4	-96.1	0.6	-0.1	-0.4	-1.1

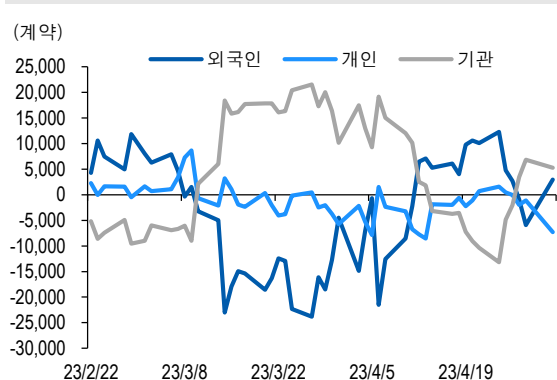
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



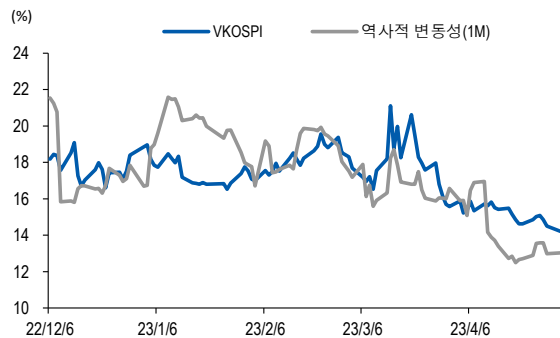
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	739,661	166.4	975,379	11.7%	지수옵션 전체	1,451,836	303.1	2,502,057			
Put	712,175	136.7	1,526,678	13.3%	PCR(금액기준)	0.82	VKOSPI	14.21%(-0.30%p)			

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	335.0(K+3)	0.68	0.27	153,276	34,032	-523	11.7	Put	330.0(K+1)	3.00	-2.59	16,228	16,602	125	12.4
	332.5(K+2)	1.32	0.49	135,710	22,539	554	11.8		327.5(K+0)	1.90	-2.12	40,694	13,249	1,121	12.7
	330.0(K+1)	2.33	0.86	81,238	24,464	-1,249	12.0		325.0(K-1)	1.14	-1.65	70,435	19,954	4,160	13.0
	327.5(K+0)	3.70	1.33	29,793	13,057	-308	12.2		322.5(K-2)	0.65	-1.21	97,866	19,407	3,841	13.4
	325.0(K-1)	5.55	1.93	7,769	13,299	339	13.1		320.0(K-3)	0.34	-0.84	112,472	27,867	5,996	13.6

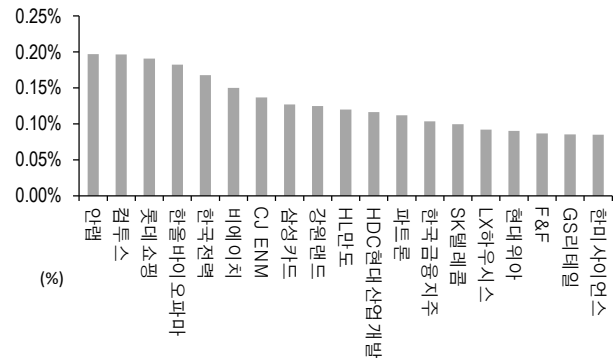
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,341,102	2,748.3	4,644,740	7,900	47,099	-47,023	1,373	6.6	-41.3	35.8	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한세실업	17,200	3.61	2.7	250.7	46,653	-887	-2.29%	-4,141	-224	4,365	4,365	0
롯데에너지	61,100	1.66	9.3	85.9	39,849	-843	0.02%	818	-924	106	237	-131
영진약품	3,045	3.40	1.2	81.4	11,577	-10,604	0.03%	15,072	-726	-14,346	-14,346	0
LG 화학	749,000	1.35	99.5	67.5	9,222	120	-0.06%	-465	-183	649	765	-116
삼성전자	65,700	0.61	621.8	67.1	1,110,849	349	-0.05%	-1,218	-14,169	15,605	17,825	-2,971
SK 이노베이션	180,000	3.99	81.4	66.0	18,319	2,769	0.08%	1,209	-286	-912	-1,220	-2,019
포스코퓨처엠	352,500	5.38	389.7	59.2	18,768	-2,466	-0.07%	-1,810	-2,177	3,708	2,889	29
현대차	202,000	2.28	62.3	54.4	55,099	976	-0.03%	3,574	-1,213	-2,361	-1,732	-214
BGF	4,230	3.05	0.3	52.9	11,562	1,247	-0.14%	1,390	283	-1,673	-1,674	0
현대건설	40,800	-0.37	10.5	52.4	17,990	677	-0.01%	-465	54	411	317	94

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터