

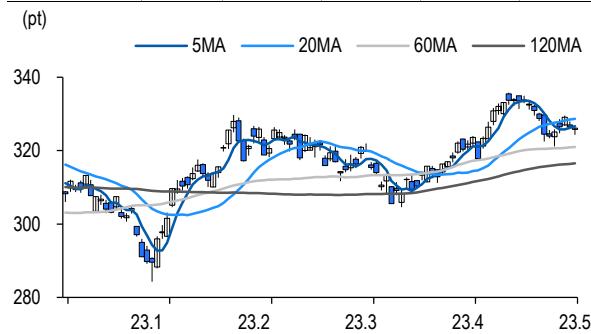


선물옵션시장 지표

2023.5.8

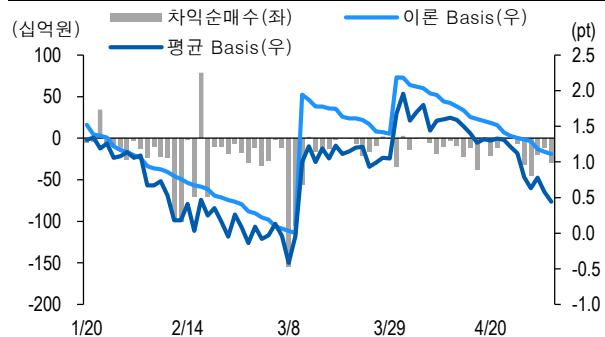
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	326.17	-0.11	-0.35	5,361.1	-
선물 6월물	325.80	-0.31	-1.00	16,676.9	319,652
선물 9월물	327.40	-0.26	-0.85	21.2	25,346
5월물(mini)	325.28	-0.31	-1.00	1,611.9	94,041
6월물(mini)	325.28	-0.47	-1.60	13.1	9,836



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.11	0.44	-0.37	-0.21%
베이시스(mini)	0.22	-0.07	-0.89	-0.09%
제1스프레드(SP)	2.02	1.45	1.45	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.22	-0.84	-0.84	-0.33%



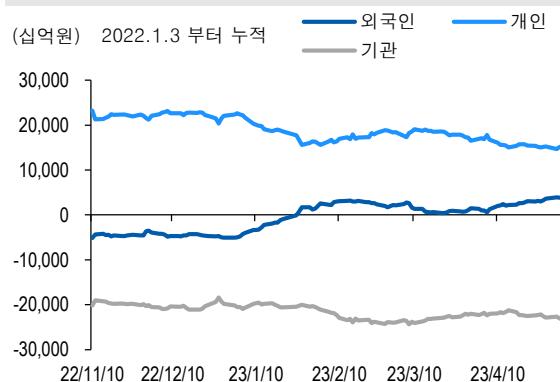
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	40.3	-12.6	27.6	0.0	94.5	-113.1	131.0	0.7	1.7	31.0
개인	227.8	33.4	261.2	0.0	6.0	68.3	-6.2	-1.6	-1.3	25.1
기관	-269.0	-16.4	-285.4	-29.7	-29.8	23.0	-124.6	1.1	-0.4	-58.0
금융투자	-256.6	-24.8	-281.5	-28.1	-9.1	-178.3	-125.7	1.2	-0.4	-42.5
투신	4.9	2.5	7.4	0.0	8.2	228.0	1.0	-0.1	-0.1	-18.5
은행+보험+기타금융	21.4	3.6	24.9	0.0	-2.7	-4.5	0.1	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-63.7	2.4	-61.3	0.0	-21.6	-22.2	0.0	0.0	0.0	3.0
기타법인	0.9	-3.8	-2.9	0.0	0.1	21.9	-0.2	-0.2	0.0	1.9

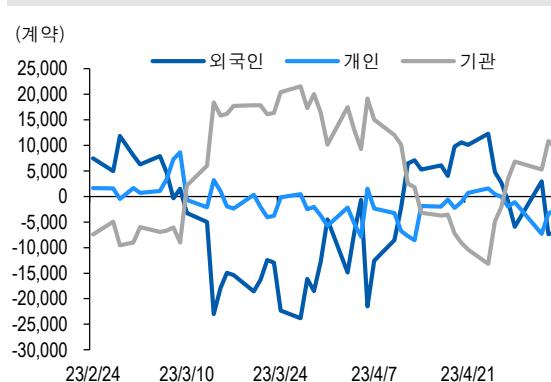
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	772,010	151.9	1,042,022	10.7%	지수옵션 전체		1,431,328	302.8	2,641,516
Put	659,318	151.0	1,599,494	15.5%	PCR(금액기준)		0.99	VKOSPI	15.27% (+0.18%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	335.0(K+3)	0.13	-0.14	131,077	45,995	10,831	11.0	330.0(K+1)	5.45
	332.5(K+2)	0.33	-0.26	153,304	30,789	7,924	10.9	327.5(K+0)	3.71
	330.0(K+1)	0.77	-0.45	187,366	35,869	6,291	10.8	325.0(K-1)	2.37
	327.5(K+0)	1.54	-0.61	107,324	17,205	2,898	10.5	322.5(K-2)	1.40
	325.0(K-1)	2.70	-0.74	46,589	16,658	2,692	9.9	320.0(K-3)	0.78
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	330.0(K+1)	5.45	0.52	5,388	16,891	496	17.4	330.0(K+1)	5.45
	327.5(K+0)	3.71	0.38	14,698	13,906	-476	16.3	327.5(K+0)	3.71
	325.0(K-1)	2.37	0.21	56,452	20,282	-501	15.8	325.0(K-1)	2.37
	322.5(K-2)	1.40	0.08	82,495	20,507	-8	15.4	322.5(K-2)	1.40
	320.0(K-3)	0.78	0.00	138,099	29,674	3,891	15.4	320.0(K-3)	0.78

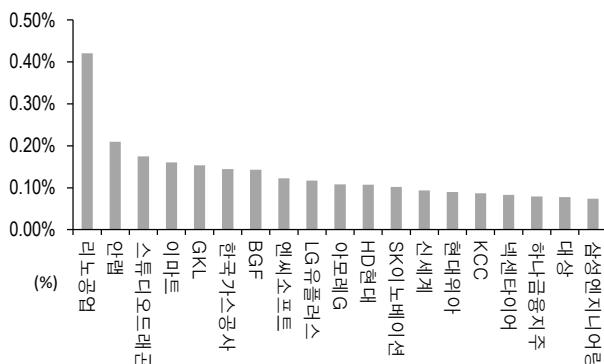
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,962,087	2,302.9	4,693,241	93,138	59,752	10,393	-71,941	31.0	25.1	-58.0
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
넥센타이어	8,490	-1.62	0.9	90.6	3,238	-206	0.08%	2,289	121	-2,410
삼성전자	64,900	-0.76	515.3	81.1	1,129,012	20,326	0.00%	5,031	2,208	-7,234
영진약품	3,015	1.86	2.4	77.2	11,697	1,695	0.03%	13,130	332	-13,462
현대제철	35,600	-1.25	9.8	72.7	25,933	1,734	0.00%	6,178	834	-7,020
한세실업	16,620	-0.48	5.2	72.3	29,270	-12,268	-0.23%	-4,237	-1,397	5,634
에코프로비엠	249,500	0.20	192.9	70.0	69,821	-4,112	-0.18%	1,256	376	-1,823
롯데에너지	60,500	1.00	6.4	66.7	35,661	-1,331	-0.04%	-77	-263	340
CJ ENM	78,000	-1.52	7.3	64.3	3,659	2,163	-0.15%	955	-45	-910
코스맥스	74,800	-0.27	4.1	63.4	4,616	1,795	-0.19%	1,506	122	-1,628
현대차	199,200	-0.90	59.2	63.2	51,148	-4,855	0.01%	-2,482	1,358	1,124

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터