

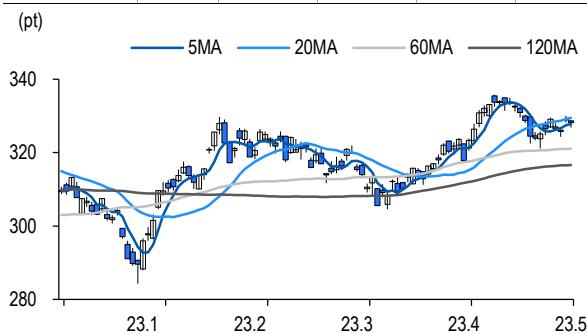


선물옵션시장 지표

2023.5.10

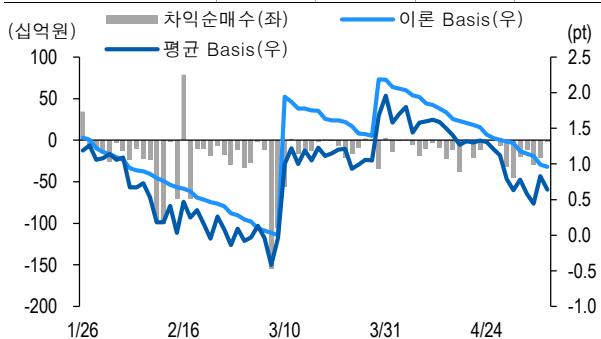
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	328.22	-0.21	-0.68	5,442.1	-
선물 6월물	328.60	-0.42	-1.40	14,293.6	319,565
선물 9월물	330.10	-0.39	-1.30	17.9	25,792
5월물(mini)	328.02	-0.41	-1.34	1,260.1	89,650
6월물(mini)	328.50	-0.45	-1.32	28.8	11,244



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.96	0.64	0.38	-0.10%
베이시스(mini)	0.06	0.08	-0.20	0.00%
제1스프레드(SP)	2.05	1.45	1.45	-0.18%
합성선물 베이시스(ATM)	0.06	-0.20	-0.20	-0.08%



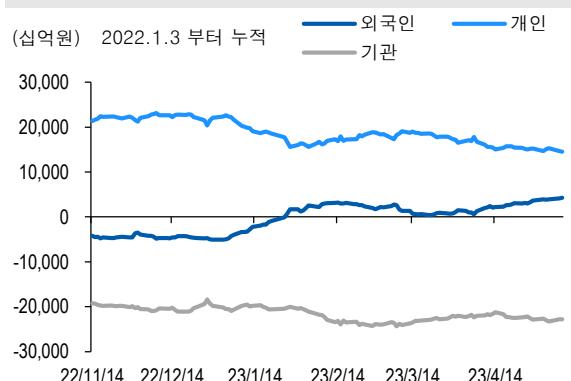
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	141.2	-1.7	139.5	0.0	31.5	-524.0	-7.1	5.1	-1.6	4.8
개인	-177.2	1.7	-175.5	0.0	6.7	37.8	0.8	-1.0	-3.4	-4.6
기관	38.2	-9.8	28.4	-1.3	-15.8	492.2	7.9	-3.7	5.4	-2.7
금융투자	-11.1	-48.3	-59.3	0.2	6.3	660.5	12.6	-2.8	5.1	8.0
투신	7.4	-3.0	4.4	0.0	-4.1	-202.4	-4.5	-1.0	0.0	-12.4
은행+보험+기타금융	2.4	15.2	17.7	0.0	-14.2	-8.3	-0.1	0.2	0.0	0.0
연기금+국가지자체	28.3	2.1	30.4	-1.6	-1.4	42.4	0.0	-0.1	0.2	1.7
기타법인	-2.2	0.7	-1.5	0.0	0.4	-5.9	-1.6	-0.4	-0.3	2.4

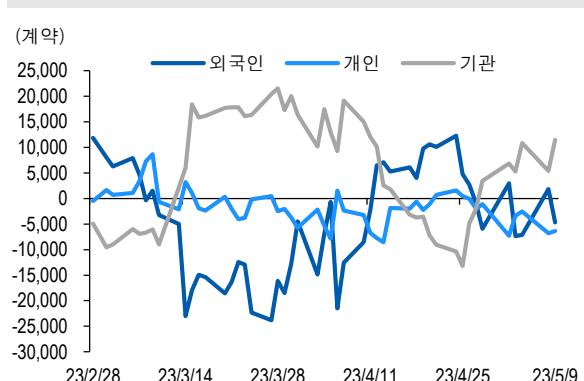
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,058,422	175.2	1,095,096	11.1%	지수옵션 전체		1,987,132	346.4	2,795,030		
Put	928,710	171.2	1,699,934	13.7%	PCR(금액기준)		0.98	VKOSPI	14.39%(-0.48%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)
	337.5(K+3)	0.02	-0.03	49,284	34,072	299	13.8		332.5(K+1)	4.64	0.89
	335.0(K+2)	0.03	-0.13	163,248	46,143	-1,468	11.2		330.0(K+0)	2.60	0.45
	332.5(K+1)	0.16	-0.41	277,562	39,867	10,931	11.0		327.5(K-1)	1.19	0.13
	330.0(K+0)	0.62	-0.84	303,123	34,610	3,039	10.8		325.0(K-2)	0.45	-0.04
	327.5(K-1)	1.71	-1.16	140,804	20,090	2,462	10.6		322.5(K-3)	0.15	-0.07
Put											

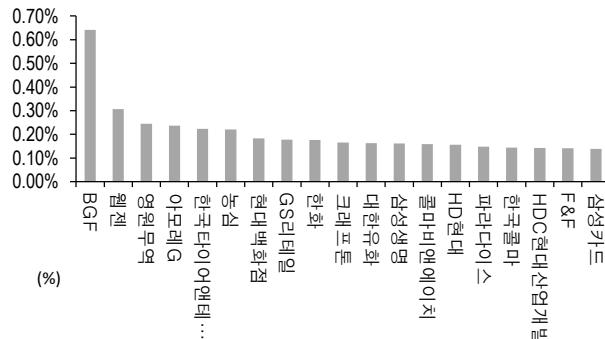
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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	3,341,793	3,076.5	4,701,052	-44,994	11,841	-8,297	-6,784	4.8	-4.6	-2.7
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
삼성전자	65,500	-0.76	464.1	76.4	676,919	-293,815	0.02%	7,677	6,648	-15,371
GKL	18,560	1.70	6.0	76.2	10,797	-9,637	-0.09%	4,861	-1,229	-3,645
에코프로비엠	236,500	-2.07	293.9	63.6	43,956	-16,065	-0.07%	4,409	7,013	-12,052
포스코퓨처엠	316,000	-1.10	249.2	59.0	10,832	-2,642	-0.02%	2,103	-623	-1,483
LG 화학	721,000	-0.69	60.6	58.4	6,361	-409	-0.03%	405	34	-439
CJ CGV	15,100	0.40	0.8	56.5	9,309	-5,514	0.01%	187	-556	369
SK 이노베이션	189,500	2.21	93.8	56.2	15,411	628	0.06%	-1,688	67	1,618
삼성전기	139,100	-0.71	16.5	49.8	10,056	-1,967	0.07%	-744	335	429
LG 에너지솔루션	564,000	1.08	46.6	49.2	10,801	-756	-0.03%	-82	-97	177
LG 전자	111,800	-0.45	31.0	49.2	16,821	-4,233	-0.03%	-411	-1,936	2,371

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터