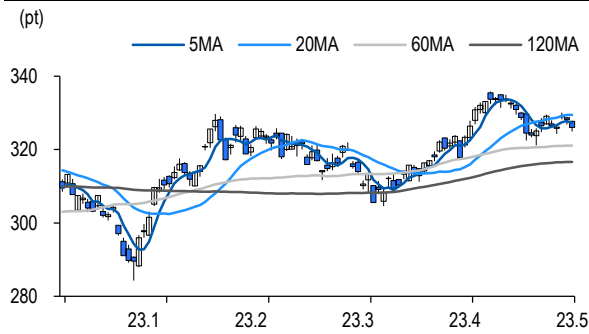


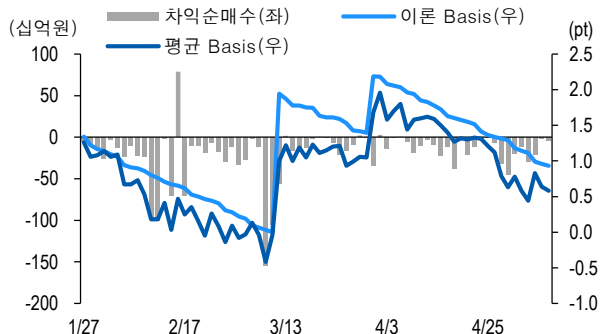
선물옵션시장 지표

2023.5.11

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	326.04	-0.66	-2.18	5,564.0	-
선물 6월물	326.50	-0.64	-2.10	14,268.3	317,012
선물 9월물	327.95	-0.65	-2.15	23.7	25,838
5월물(mini)	325.94	-0.63	-2.08	1,359.3	88,308
6월물(mini)	326.42	-0.66	-2.08	62.3	12,989

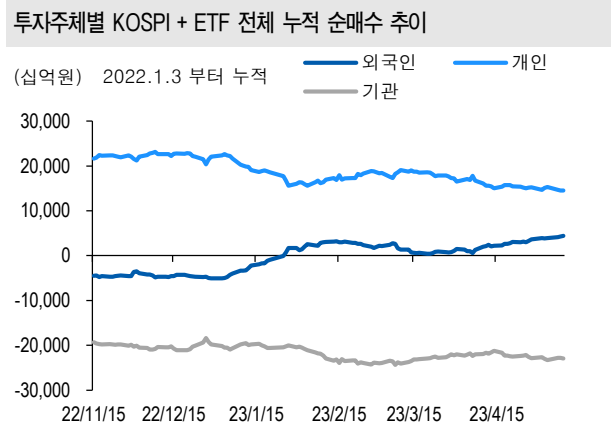


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.93	0.58	0.46	-0.11%	
베이스스(mini)	0.03	0.02	-0.10	0.00%	
제1스프레드(SP)	2.03	1.47	1.45	-0.17%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.03	-0.11	-0.11	-0.04%	

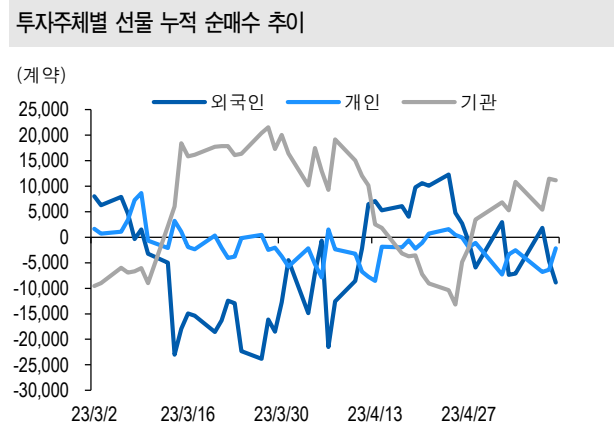


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	121.0	16.6	137.5	0.0	9.8	-315.1	-32.0	0.1	0.4	-2.0	
개인	6.3	22.6	29.0	0.0	0.2	311.3	30.4	-0.3	1.4	14.8	
기관	-123.4	-57.3	-180.7	-3.6	-52.4	-29.6	0.9	2.0	-1.1	-14.8	
금융투자	-115.3	-67.4	-182.7	-3.6	5.5	-102.7	0.4	2.6	-1.3	-8.2	
투신	-6.3	10.5	4.2	0.0	2.4	87.6	-1.4	-0.6	0.0	-7.6	
은행+보험+기타금융	2.5	3.7	6.2	0.0	-1.5	5.9	1.9	0.0	0.2	0.1	
연기금+국가자재	-61.5	2.1	-59.4	0.0	-69.2	-20.4	0.0	0.0	0.0	1.0	
기타법인	-3.9	19.2	15.3	0.0	0.2	33.4	0.6	-1.7	-0.8	2.0	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



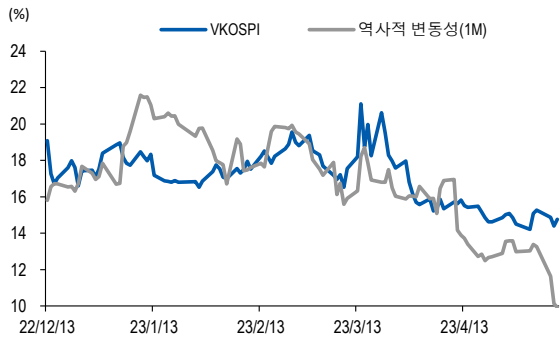
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,183,565	197.5	1,144,184	11.6%	지수옵션 전체	2,323,263	408.8	2,889,315
Put	1,139,698	211.3	1,745,131	13.9%	PCR(금액기준)	1.07	VKOSPI	14.77%(+0.38%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	335.0(K+3)	0.01	-0.02	50,087	47,419	1,276	15.1	Put	330.0(K+1)	4.18	1.58	38,706	17,911	-2,205	15.3
	332.5(K+2)	0.02	-0.14	202,089	44,833	4,966	12.5		327.5(K+0)	2.09	0.90	193,218	18,785	-2,004	13.2
	330.0(K+1)	0.10	-0.52	371,554	44,674	10,064	11.4		325.0(K-1)	0.79	0.34	329,256	30,338	-5,267	13.2
	327.5(K+0)	0.52	-1.19	354,530	30,710	10,620	11.2		322.5(K-2)	0.25	0.10	242,037	34,395	-2,747	14.1
	325.0(K-1)	1.70	-1.78	101,706	19,464	3,049	11.0		320.0(K-3)	0.07	0.02	105,749	43,265	2,102	15.2

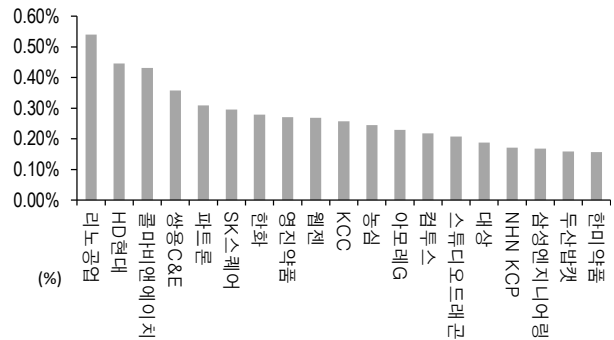
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	3,287,004	2,877.9	4,647,277	-53,775	-20,496	45,091	-24,587	-2.0	14.8	-14.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
씨젠	24,300	-0.41	3.9	95.6	26,166	-12,363	0.02%	93	-672	579	-1,570	0
카카오페이	56,600	-3.08	7.3	81.5	15,874	-7,565	-0.07%	586	257	-843	116	-288
에코프로비엠	232,000	-1.90	193.3	75.3	26,829	-17,127	-0.05%	1,144	1,112	-2,222	-353	0
LG 에너지솔루션	564,000	0.00	57.5	70.5	6,403	-4,398	-0.05%	-84	-142	218	246	-165
삼성전자	64,600	-1.37	556.9	66.0	422,284	-254,635	0.02%	11,873	20,235	-30,183	-31,106	804
포스코퓨처엠	306,500	-3.01	161.6	54.5	7,528	-3,304	0.03%	-443	902	-524	-312	70
에스엠	105,400	2.03	14.7	51.6	13,465	-5,992	-0.17%	-1,089	154	831	2,864	0
삼성 SDI	670,000	-1.62	47.6	50.9	10,315	-401	-0.03%	132	66	-199	-515	303
현대제철	35,700	-1.52	4.0	46.8	17,638	-3,412	0.06%	495	-33	-462	-443	-59
한세실업	16,900	-2.20	2.2	45.6	17,745	-7,862	-0.03%	-3,134	-256	3,390	3,394	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터