

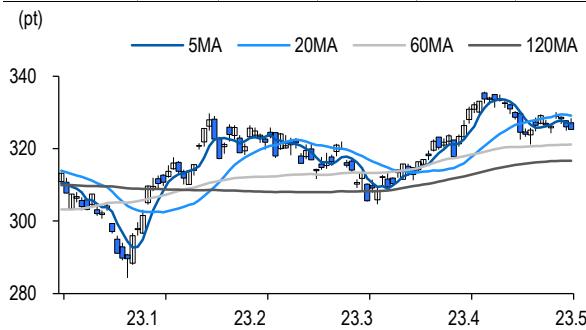


선물옵션시장 지표

2023.5.12

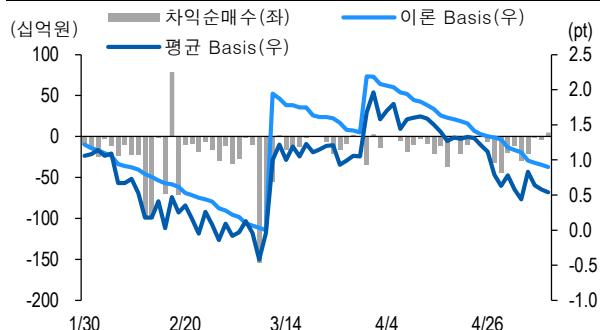
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	325.28	-0.23	-0.76	5,621.5	-
선물 6월물	325.40	-0.34	-1.10	17,547.0	315,168
선물 9월물	326.80	-0.35	-1.15	32.9	26,636
5월물(mini)	325.66	-0.09	-0.28	705.8	0
6월물(mini)	325.44	-0.32	-0.98	642.3	18,434



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.90	0.54	0.12	-0.11%
베이시스(mini)	0.00	0.01	0.38	0.00%
제1스프레드(SP)	2.02	1.46	1.50	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	0.39	0.39	0.12%



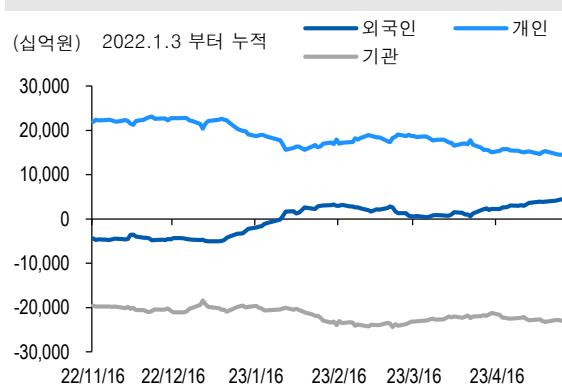
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	0.1	25.2	25.3	0.0	65.8	-155.4	131.6	-0.8	-1.2	-0.6
개인	-85.0	-24.4	-109.4	0.0	1.1	232.3	20.0	3.1	-1.5	-8.1
기관	84.8	5.0	89.8	5.0	-135.2	-97.4	-152.5	-1.0	3.3	8.6
금융투자	16.2	-1.5	14.7	4.6	-147.9	-181.2	-153.2	0.7	2.8	58.0
투신	26.2	-3.6	22.6	0.0	-16.8	96.7	-0.5	-1.3	0.1	-2.4
은행+보험+기타금융	8.1	17.7	25.8	0.0	-3.3	-10.5	1.1	-0.2	0.3	0.3
연기금+국가지자체	17.6	-3.1	14.5	0.2	28.1	-2.4	0.0	-0.2	0.0	-47.2
기타법인	0.1	-0.9	-0.8	0.0	0.3	20.4	0.9	-1.3	-0.7	0.1

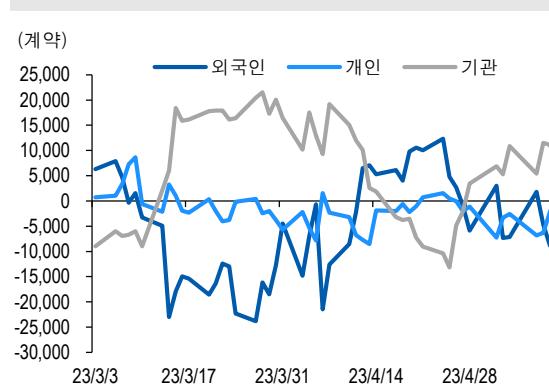
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,630,127	231.8	655,687	9.7%	지수옵션 전체	3,142,336	446.9	1,634,040
Put	1,512,209	215.1	978,353	9.0%	PCR(금액기준)	0.93	VKOSPI	14.31%(-0.46%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	332.5(K+3)	0.01	-0.01	62,116	0	-44,833	17.8	Put
	330.0(K+2)	0.01	-0.09	471,812	0	-44,674	12.4	
	327.5(K+1)	0.02	-0.50	796,883	0	-30,710	7.3	
	325.0(K+0)	0.79	-0.91	152,657	0	-19,464	9.2	
	322.5(K-1)	3.23	-0.43	11,721	0	-8,576	20.7	
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	327.5(K+1)	1.87	-0.22	549,702	0	-18,785	12.0	
	325.0(K+0)	0.12	-0.67	547,935	0	-30,338	3.6	
	322.5(K-1)	0.01	-0.24	104,613	0	-34,395	8.1	
	320.0(K-2)	0.01	-0.06	22,607	0	-43,265	14.0	
	317.5(K-3)	0.01	-0.01	1,590	0	-43,372	19.6	

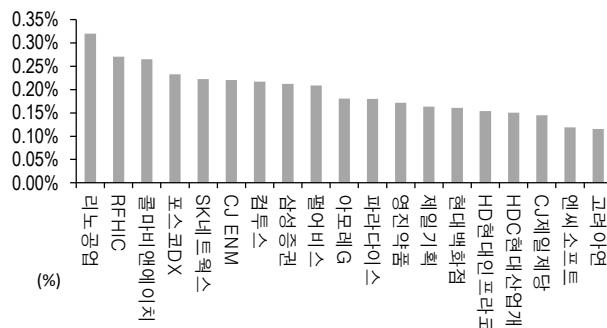
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,924,545	3,190.7	3,590,657	-1,056,620	-20,726	-27,101	43,150	-0.6	-8.1	8.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
CJ ENM	76,600	2.41	3.1	59.5	0	-2,582	0.22%	-50	-322	372
씨젠	24,400	0.41	4.3	53.9	0	-26,166	0.04%	2,177	1,012	-3,189
RFHIC	21,850	-2.24	2.7	45.5	0	-14,449	0.27%	-1,741	-1,168	2,909
삼성전자	64,300	-0.46	322.4	42.9	0	-422,284	-0.07%	9,462	-13,240	3,452
카카오페이	56,500	-0.18	4.2	41.7	0	-15,874	0.00%	-346	-28	374
현대차	209,000	-0.24	68.2	35.5	0	-25,557	-0.04%	-347	690	-402
천보	184,600	-0.43	4.7	35.0	0	-5,279	-0.14%	-357	-108	544
셀트리온헬스케어	72,900	-0.55	15.9	33.0	0	-17,714	-0.10%	-1,828	1,588	240
LG 이노텍	272,000	0.00	11.9	31.1	0	-18,773	0.04%	164	1,147	-1,308
에코프로비엠	222,500	-4.09	128.9	29.9	0	-26,829	0.05%	3,379	1,437	-4,114

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터