

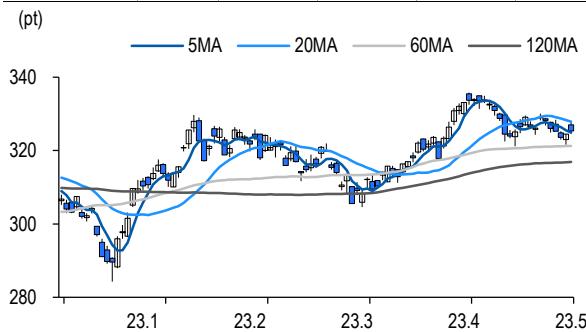


선물옵션시장 지표

2023.5.17

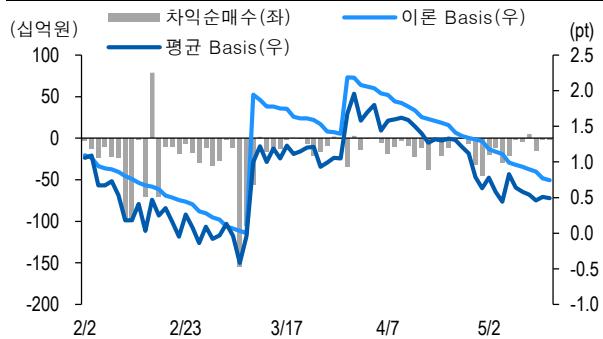
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	325.31	0.26	0.85	5,192.3	-
선물 6월물	325.55	0.12	0.40	15,242.2	315,593
선물 9월물	327.10	0.15	0.50	73.8	27,168
6월물(mini)	325.52	0.11	0.30	994.4	21,308
7월물(mini)	325.60	0.16	0.52	2.2	14,930



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.74	0.49	0.24	-0.08%
베이시스(mini)	0.74	0.48	0.21	-0.08%
제1스프레드(SP)	2.08	1.40	1.40	-0.21%
합성선물 베이시스(ATM)	0.74	0.27	0.27	-0.15%



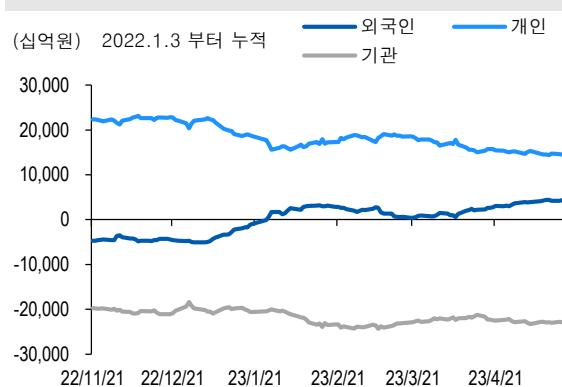
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	227.4	-18.6	208.9	0.4	165.3	-201.5	-6.9	0.8	-4.5	-24.8
개인	-127.0	-2.0	-129.0	0.0	-3.4	89.8	-11.0	-0.8	3.2	-4.2
기관	-57.5	-2.0	-59.5	-2.7	-21.0	178.3	17.8	-0.1	2.0	34.5
금융투자	-12.0	13.5	1.5	-10.2	-1.7	246.2	12.9	-0.1	2.1	39.3
투신	-1.7	-16.1	-17.7	0.0	-8.0	-66.1	4.7	0.1	0.0	-6.0
은행+보험+기타금융	0.6	0.5	1.1	0.0	-7.8	9.4	0.1	0.0	-0.1	0.7
연기금+국가지자체	0.9	0.0	0.9	9.1	-3.6	-11.2	0.0	0.0	0.0	0.6
기타법인	-42.9	4.9	-38.0	0.0	-0.5	-66.6	0.2	0.0	-0.8	-5.5

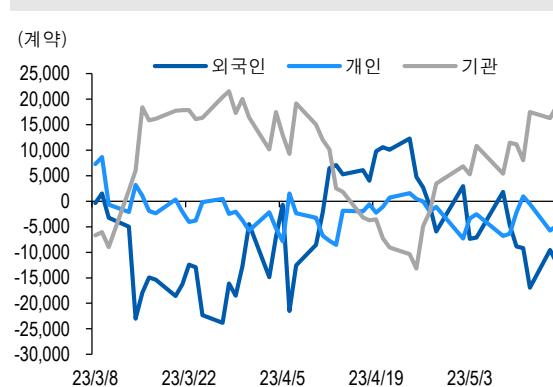
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	543,444	138.5	785,368	10.6%	지수옵션 전체	1,185,440	276.5	1,999,107
Put	641,996	138.0	1,213,739	13.1%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	13.59%(-0.22%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	332.5(K+3)	1.27	-0.02	76,649	16,361	2,962	10.7	Put	327.5(K+1)	4.90	-0.44	5,991	3,872	1,025	12.5
	330.0(K+2)	2.03	0.01	42,710	21,611	-1,204	10.9		325.0(K+0)	3.65	-0.42	30,189	20,849	5,222	12.5
	327.5(K+1)	2.99	-0.02	14,737	8,818	16	11.0		322.5(K-1)	2.69	-0.33	35,234	12,740	2,052	12.8
	325.0(K+0)	4.23	0.01	7,948	13,983	-552	11.0		320.0(K-2)	1.93	-0.29	55,014	22,182	886	13.0
	322.5(K-1)	5.78	0.11	1,180	2,217	-164	11.2		317.5(K-3)	1.36	-0.22	69,650	11,189	2,211	13.3

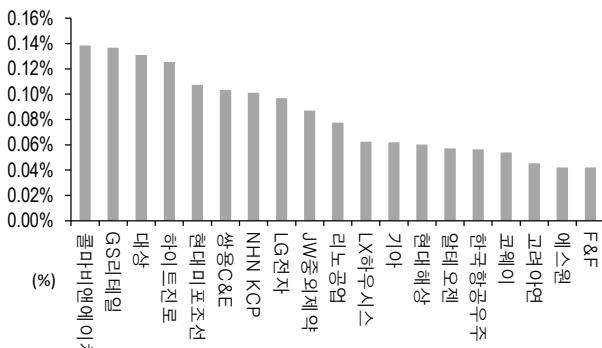
자료: KRX, 유안타증권 리서치센-

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센-

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,095,009	2,389.7	4,187,008	135,073	-60,653	29,218	38,136	-24.8	-4.2	34.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한울바이오파마	21,400	0.23	4.0	125.0	6,987	-274	0.03%	3,487	-230	-3,257	-3,257	0
SK 이노베이션	177,300	0.45	41.9	79.5	14,020	-1,657	-0.12%	281	-4	-263	997	820
삼성전자	65,400	1.08	630.5	78.9	1,133,980	54,080	0.01%	-23,752	21,145	2,149	-5,834	3,970
BGF	4,110	-0.96	0.2	69.9	10,248	-546	-0.24%	-1,543	2	1,539	1,539	0
현대건설	39,000	-0.51	6.5	67.0	16,268	-1,229	-0.09%	-2,304	1,651	653	551	102
롯데에너지	58,100	-2.52	6.6	65.8	37,050	-316	-0.04%	115	-107	-8	-183	175
LG 화학	697,000	0.43	81.3	65.2	7,856	609	-0.04%	-696	142	552	657	-99
에코프로비엠	229,500	2.46	167.2	65.1	62,961	-2,070	-0.20%	-918	-844	1,686	1,661	0
삼성 SDI	672,000	-0.30	51.0	56.0	11,537	932	-0.05%	-164	-12	169	801	-603
현대차	202,500	-2.88	98.3	55.5	50,836	138	-0.03%	-339	944	-686	-250	-260

자료: KRX, 유안타증권 리서치센-