

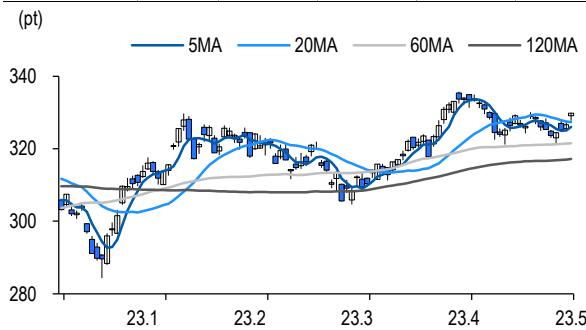


## 선물옵션시장 지표

2023.5.19

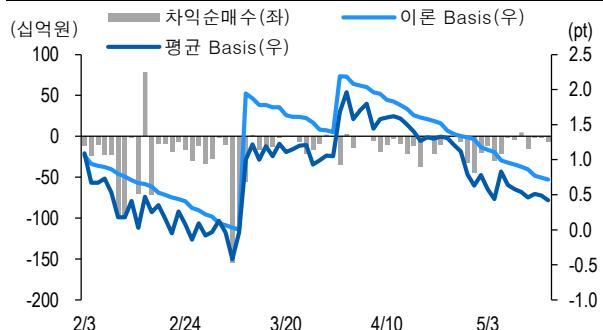
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	326.61	0.40	1.30	4,530.5	-
선물 6월물	326.50	0.29	0.95	12,893.9	318,578
선물 9월물	328.00	0.28	0.90	83.5	27,747
6월물(mini)	326.50	0.29	0.98	778.0	22,624
7월물(mini)	326.56	0.29	0.96	2.0	14,930



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.72	0.42	-0.11	-0.09%
베이시스(mini)	0.72	0.42	-0.11	-0.09%
제1스프레드(SP)	2.09	1.43	1.45	-0.20%
합성선물 베이시스(ATM)	0.72	-0.07	-0.07	-0.24%



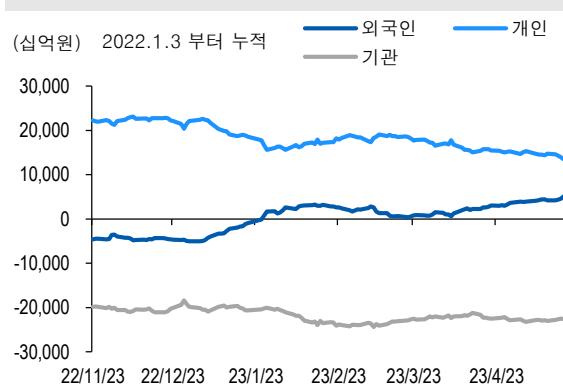
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

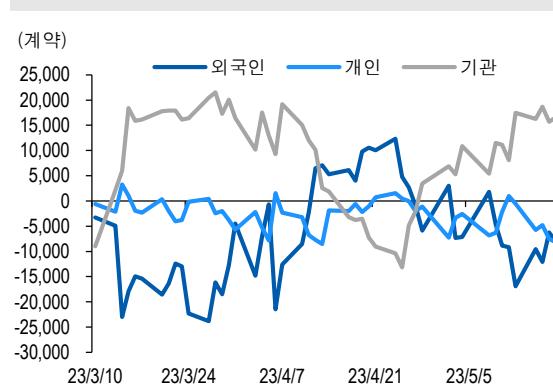
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	527.8	1.1	528.9	0.0	278.6	-137.9	-1.1	0.2	0.1	-4.0
개인	-445.9	4.7	-441.2	0.0	-0.7	-33.9	-14.7	1.1	-1.9	-1.4
기관	-81.6	23.0	-58.6	-4.7	-4.1	50.9	15.7	-2.3	1.6	6.7
금융투자	-84.0	13.7	-70.3	-10.8	-10.0	35.6	17.5	-2.9	2.2	-21.6
투신	17.2	6.0	23.2	0.0	4.1	-4.5	-2.6	0.0	-0.1	6.6
은행+보험+기타금융	16.7	7.0	23.7	0.0	-3.3	-6.1	0.8	0.5	-0.5	0.0
연기금+국가지자체	10.3	-4.7	5.6	5.4	4.7	26.0	0.0	0.0	0.0	21.7
기타법인	-0.3	-13.6	-13.9	0.0	-0.1	120.8	0.0	1.1	0.2	-1.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	447,005	116.2	810,577	10.3%	지수옵션 전체	854,573	211.8	2,076,596
Put	407,568	95.6	1,266,019	13.3%	PCR(금액기준)	0.82	VKOSPI	13.52%(-0.07%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	332.5(K+3)	1.46	0.19	79,537	17,421	1,060	10.4	327.5(K+1)
	330.0(K+2)	2.29	0.26	42,117	22,584	973	10.5	325.0(K+0)
	327.5(K+1)	3.33	0.34	13,179	10,855	2,037	10.4	322.5(K-1)
	325.0(K+0)	4.67	0.44	6,793	14,029	46	10.3	320.0(K-2)
	322.5(K-1)	6.31	0.53	1,093	2,206	-11	10.3	317.5(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	327.5(K+1)	4.26	-0.64	5,810	4,385	513	12.8	325.0(K+0)
	325.0(K+0)	3.13	-0.52	16,701	23,882	3,033	12.9	322.5(K-1)
	322.5(K-1)	2.24	-0.45	24,765	13,741	1,001	13.0	320.0(K-2)
	320.0(K-2)	1.58	-0.35	44,909	24,572	2,390	13.3	317.5(K-3)
	317.5(K-3)	1.07	-0.29	64,732	12,016	827	13.4	

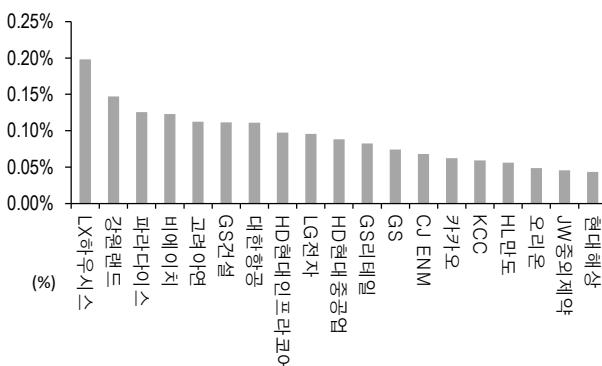
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	2,799,647	2,078.6	4,311,024	124,016	54,735	47,534	-101,398	27.5	11.4	-37.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	65,300	-0.15	600.3	90.1	1,135,082	1,102	0.01%	-8,682	-2,822	11,402
롯데에너지	60,100	3.44	6.3	82.1	37,301	251	0.03%	960	16	-978
카카오	57,900	3.02	88.9	76.1	255,705	57,199	0.06%	5,923	50,164	-56,089
현대차	206,000	1.73	77.0	68.8	50,402	-434	-0.07%	550	-898	345
LG 화학	709,000	1.72	61.9	64.6	7,429	-427	-0.06%	622	-402	-219
씨젠	22,650	-0.22	2.8	55.9	67,024	4,008	-0.83%	419	-485	61
현대건설	38,700	-0.77	5.1	55.6	18,152	1,884	-0.05%	-789	814	-25
에코프로비엠	232,500	1.31	84.1	53.8	61,759	-1,202	-0.17%	-901	798	128
영진약품	2,925	2.27	0.5	52.3	8,861	2,788	-0.07%	8,051	-262	-7,950
SK 이노베이션	182,800	3.10	38.0	52.2	14,789	769	-0.02%	2,299	609	-2,889

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터