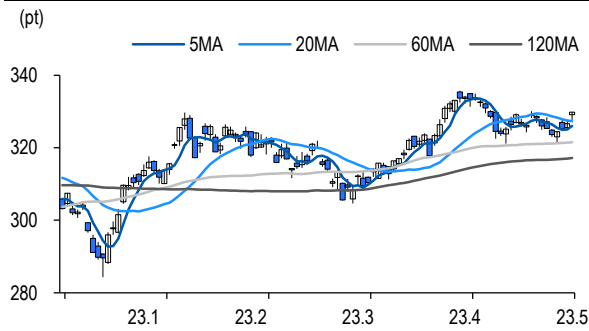


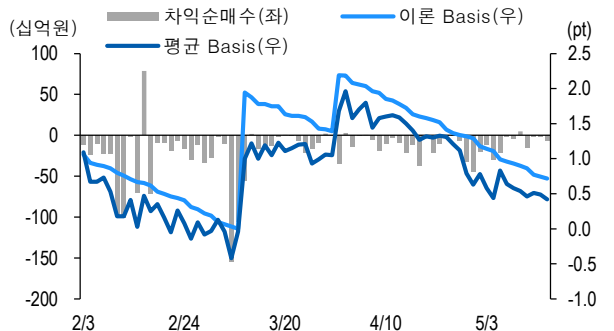
선물옵션시장 지표

2023.5.19

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(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

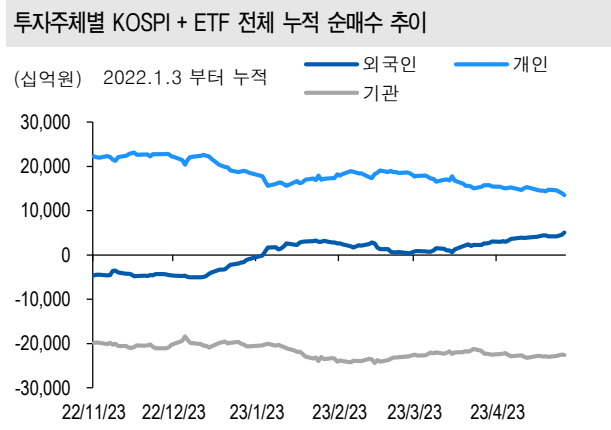


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.72	0.42	-0.11	-0.09%
베이스스(mini)	0.72	0.42	-0.11	-0.09%
제1스프레드(SP)	2.09	1.43	1.45	-0.20%
합성선물 베이스스(ATM)	0.72	-0.07	-0.07	-0.24%

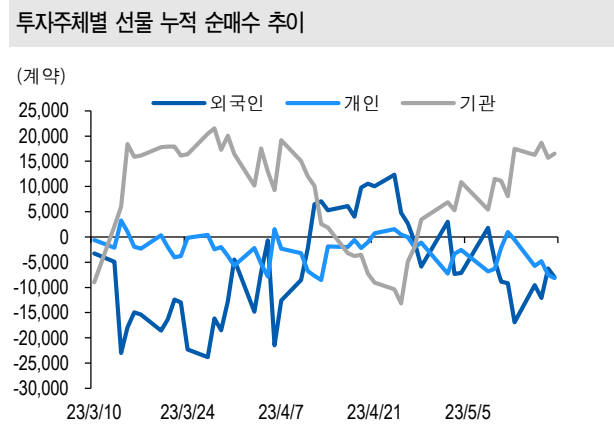


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	527.8	1.1	528.9	0.0	278.6	-137.9	-1.1	0.2	0.1	-4.0
개인	-445.9	4.7	-441.2	0.0	-0.7	-33.9	-14.7	1.1	-1.9	-1.4
기관	-81.6	23.0	-58.6	-4.7	-4.1	50.9	15.7	-2.3	1.6	6.7
금융투자	-84.0	13.7	-70.3	-10.8	-10.0	35.6	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+국가자자체	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



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



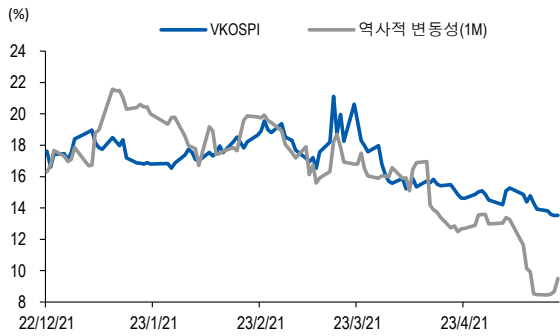
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	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)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	332.5(K+3)	1.46	0.19	79,537	17,421	1,060	10.4	Put	327.5(K+1)	4.26	-0.64	5,810	4,385	513	12.8
	330.0(K+2)	2.29	0.26	42,117	22,584	973	10.5		325.0(K+0)	3.13	-0.52	16,701	23,882	3,033	12.9
	327.5(K+1)	3.33	0.34	13,179	10,855	2,037	10.4		322.5(K-1)	2.24	-0.45	24,765	13,741	1,001	13.0
	325.0(K+0)	4.67	0.44	6,793	14,029	46	10.3		320.0(K-2)	1.58	-0.35	44,909	24,572	2,390	13.3
	322.5(K-1)	6.31	0.53	1,093	2,206	-11	10.3		317.5(K-3)	1.07	-0.29	64,732	12,016	827	13.4

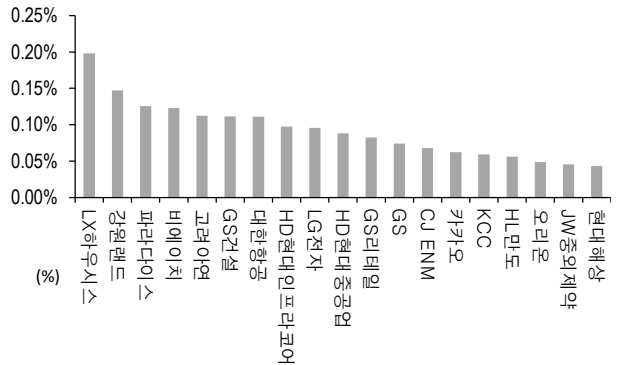
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	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 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	65,300	-0.15	600.3	90.1	1,135,082	1,102	0.01%	-8,682	-2,822	11,402	25,449	-5,514
롯데에너지	60,100	3.44	6.3	82.1	37,301	251	0.03%	960	16	-978	43	-738
카카오	57,900	3.02	88.9	76.1	255,705	57,199	0.06%	5,923	50,164	-56,089	-50,753	-5,344
현대차	206,000	1.73	77.0	68.8	50,402	-434	-0.07%	550	-898	345	748	-403
LG 화학	709,000	1.72	61.9	64.6	7,429	-427	-0.06%	622	-402	-219	-263	68
씨젠	22,650	-0.22	2.8	55.9	67,024	4,008	-0.83%	419	-485	61	3,849	0
현대건설	38,700	-0.77	5.1	55.6	18,152	1,884	-0.05%	-789	814	-25	-394	369
에코프로비엠	232,500	1.31	84.1	53.8	61,759	-1,202	-0.17%	-901	798	128	92	0
영진약품	2,925	2.27	0.5	52.3	8,861	2,788	-0.07%	8,051	-262	-7,950	-7,950	0
SK 이노베이션	182,800	3.10	38.0	52.2	14,789	769	-0.02%	2,299	609	-2,889	-1,851	-1,038

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터