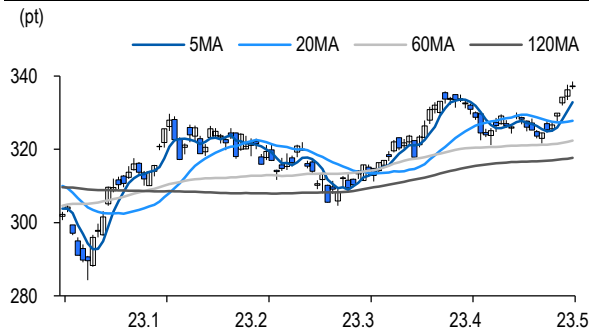


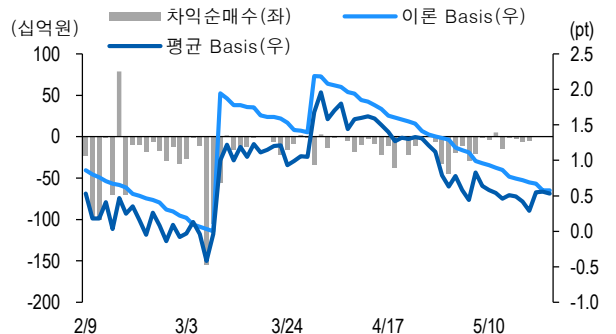
선물옵션시장 지표

2023.5.24

Market Data		(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제	
KOSPI200	337.09	0.24	0.82	4,918.7	-	
선물 6월물	338.00	0.30	1.00	16,267.5	329,203	
선물 9월물	339.50	0.25	0.85	117.9	34,136	
6월물(mini)	338.04	0.31	1.02	917.7	31,929	
7월물(mini)	337.98	0.32	1.08	15.9	27,435	

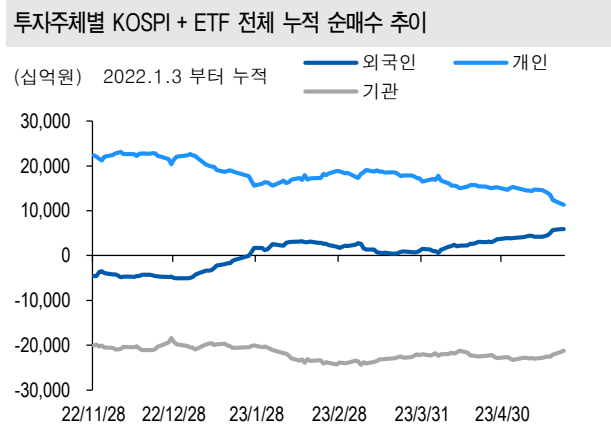


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.58	0.56	0.91	0.00%	
베이스스(mini)	0.58	0.55	0.95	-0.01%	
제1스프레드(SP)	2.22	1.60	1.60	-0.18%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.58	0.75	0.88	0.05%	

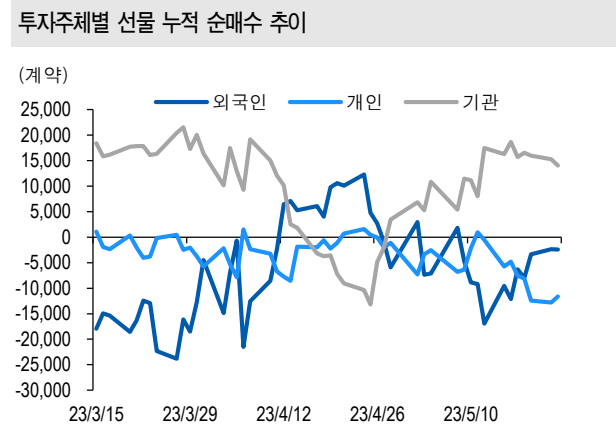


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-53.9	2.0	-51.8	0.0	-83.1	-2.6	-0.2	-3.8	-7.1	9.5	
개인	-338.5	60.3	-278.2	0.0	0.0	94.4	1.0	1.9	0.7	3.9	
기관	399.4	-85.7	313.7	-0.5	-27.5	-103.0	-1.5	2.4	7.2	-12.2	
금융투자	353.9	-21.3	332.6	0.1	0.7	-23.6	3.4	1.6	1.6	-13.6	
투신	-16.8	-6.8	-23.6	0.0	-36.3	-170.0	-3.9	0.5	0.1	1.6	
은행+보험+기타금융	10.9	-61.3	-50.4	0.0	-3.8	91.9	-1.0	0.2	5.5	0.7	
연기금+국가자재	45.1	10.9	56.0	0.0	19.0	-1.3	0.0	0.0	0.0	-0.8	
기타법인	-7.0	2.5	-4.6	0.0	-0.5	11.2	0.7	-0.5	-0.8	-1.2	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

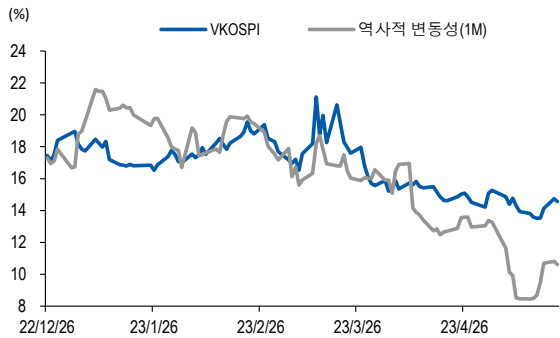
지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	718,582	180.9	932,722	12.4%	지수옵션 전체	1,254,401	305.5	2,417,398
Put	535,819	124.7	1,484,676	12.5%	PCR(금액기준)	0.69	VKOSPI	14.56%(-0.18%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	345.0(K+3)	1.08	0.00	108,132	29,849	965	12.4	Put	340.0(K+1)	4.66	-0.77	7,510	5,248	1,124	11.6
	342.5(K+2)	1.73	0.07	92,748	27,962	940	12.5		337.5(K+0)	3.36	-0.70	13,234	5,691	3,011	11.9
	340.0(K+1)	2.65	0.18	41,897	29,768	-106	12.7		335.0(K-1)	2.34	-0.59	39,348	12,644	3,627	12.1
	337.5(K+0)	3.83	0.26	14,758	21,527	219	12.9		332.5(K-2)	1.56	-0.49	55,092	11,588	509	12.4
	335.0(K-1)	5.30	0.35	6,916	24,296	-50	13.2		330.0(K-3)	1.02	-0.35	76,229	25,258	3,808	12.7

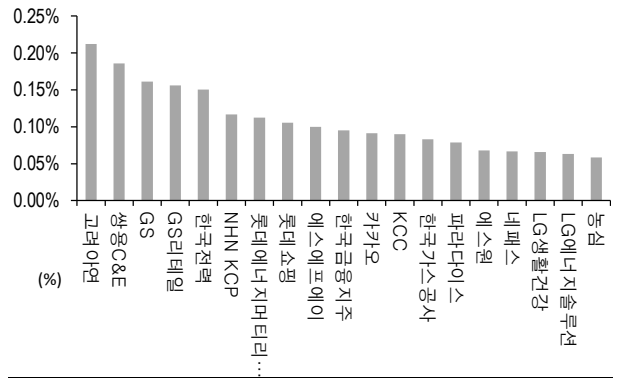
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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	2,408,602	2,186.6	4,565,510	15,781	4,133	-3,231	-1,643	9.5	3.9	-12.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	68,600	-0.15	470.4	80.6	1,181,320	1,721	0.00%	9,376	-23,848	14,526	23,648	-2,410
SK 이노베이션	184,200	1.88	89.5	78.1	16,968	1,563	0.03%	681	443	-1,167	-1,130	-37
RFHIC	22,700	1.79	2.3	73.3	26,593	571	-0.12%	-559	514	45	45	0
SK 하이닉스	98,100	-0.30	149.5	61.9	220,641	-10,991	0.00%	-657	6,776	-6,350	-8,382	-554
삼성 SDI	709,000	1.58	69.0	56.1	11,441	-290	0.04%	164	338	-509	-719	210
롯데에너지머티리얼즈	57,100	1.42	6.8	55.8	36,218	325	0.11%	1,467	-43	-1,424	-1,671	247
현대차	208,000	0.24	41.1	55.6	48,521	-1,613	-0.10%	-1,949	-1,363	3,311	2,937	386
포스코퓨처엠	334,000	2.77	238.1	53.7	21,032	82	-0.09%	-1,248	-7	1,272	362	-7
LG 화학	720,000	2.42	144.7	53.3	9,854	1,944	0.02%	1,022	986	-1,996	-2,476	486
삼성전기	144,000	0.70	26.4	50.8	13,153	1,074	0.01%	-748	1,344	-593	-530	-63

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터