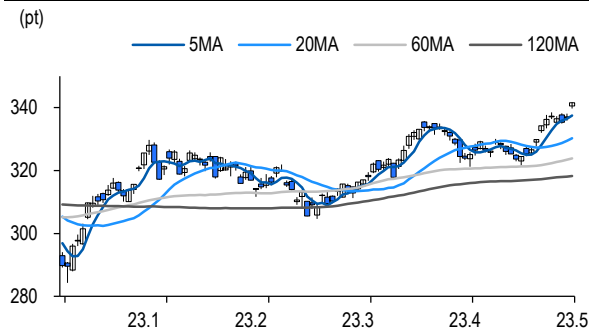


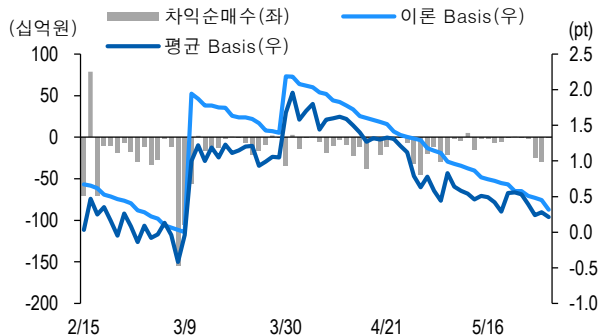
선물옵션시장 지표

2023.5.31

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	341.50	1.30	4.39	7,942.1	-
선물 6월물	342.05	1.26	4.25	17,445.3	324,758
선물 9월물	343.65	1.31	4.45	176.5	34,539
6월물(mini)	342.04	1.26	4.36	806.1	39,937
7월물(mini)	341.92	1.36	4.58	12.4	31,043

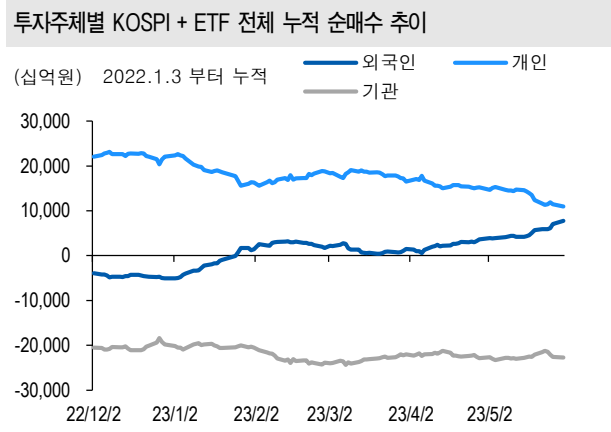


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.32	0.21	0.55	-0.03%
베이스(mini)	0.32	0.20	0.54	-0.03%
제1스프레드(SP)	2.36	1.73	1.75	-0.18%
합성선물 베이스(ATM)	0.32	0.55	0.55	0.07%

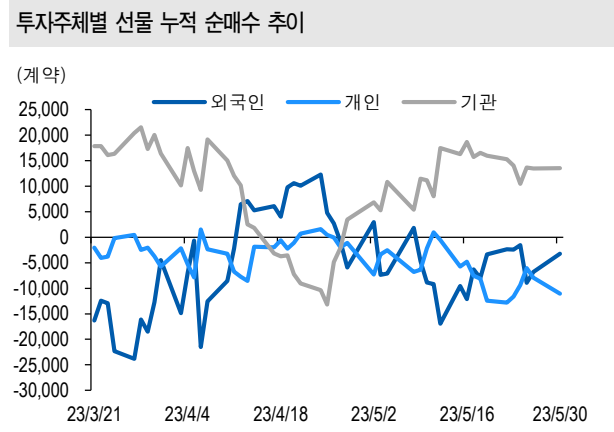


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	672.5	15.3	687.8	0.0	255.9	313.0	-7.9	-6.9	0.5	14.8
개인	-542.1	2.4	-539.8	0.0	-4.8	-256.1	-9.0	7.1	-2.8	43.4
기관	-112.6	-26.1	-138.7	-0.2	-22.7	-9.7	17.6	-0.1	2.6	-57.4
금융투자	53.6	18.3	71.9	-0.2	5.7	-251.9	16.4	-4.7	3.5	-49.2
투신	-71.1	1.7	-69.3	0.0	-14.3	323.2	-0.5	0.2	0.2	-5.8
은행+보험+기타금융	-29.0	-44.4	-73.4	0.0	-17.4	-41.9	1.8	4.4	-1.1	0.9
연기금+국가자재	-23.9	0.9	-23.0	0.0	6.3	-39.1	0.0	0.0	0.0	-3.3
기타법인	-17.7	1.9	-15.8	0.0	-0.1	-47.1	-0.7	-0.1	-0.2	-0.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

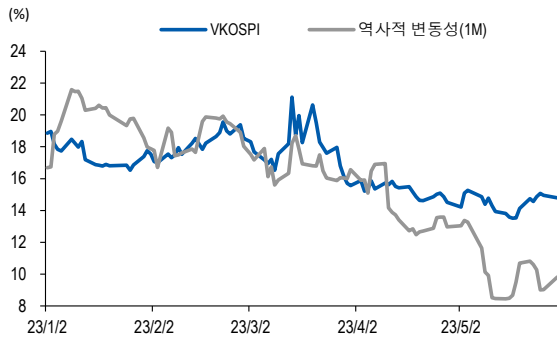
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	914,524	233.4	1,019,021	12.2%	지수옵션 전체	1,640,818	367.6	2,674,622
Put	726,294	134.1	1,655,601	13.0%	PCR(금액기준)	0.57	VKOSPI	14.79%(-0.17%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	345.0(K+3)	1.48	0.73	160,342	28,990	558	12.2	Put	340.0(K+1)	1.85	-2.60	44,968	15,915	9,329	11.9
	342.5(K+2)	2.45	1.14	106,072	31,659	-126	12.2		337.5(K+0)	1.08	-2.05	65,263	13,967	4,651	12.1
	340.0(K+1)	3.87	1.72	38,299	31,544	-1,049	12.7		335.0(K-1)	0.64	-1.49	124,168	24,252	7,735	12.7
	337.5(K+0)	5.63	2.34	8,275	24,426	-358	13.2		332.5(K-2)	0.35	-1.05	84,622	17,700	3,245	13.1
	335.0(K-1)	7.68	2.89	4,721	23,361	7	14.1		330.0(K-3)	0.20	-0.71	79,541	31,054	3,331	13.8

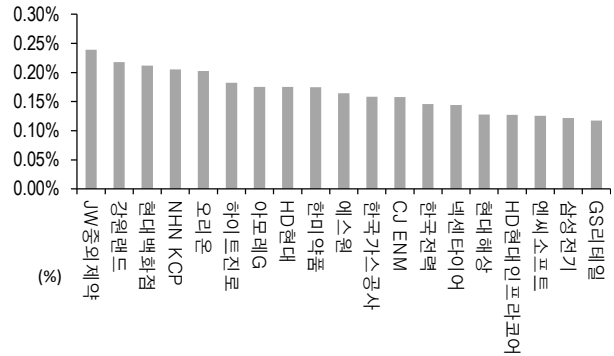
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,777,452	3,212.1	4,810,221	12,499	44,773	42,974	-90,619	14.8	43.4	-57.4			

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넷마블	56,500	-0.53	6.9	68.3	8,251	-3,902	0.10%	1,775	333	-2,108	-5,260	-95
SK 하이닉스	110,500	1.28	584.9	61.1	248,027	-1,961	-0.10%	3,128	-1,586	-1,074	10,587	1,380
포스코퓨처엠	342,500	5.38	183.0	55.1	20,139	43	-0.03%	-1,009	-633	1,799	1,278	149
현대건설	39,000	-0.51	7.4	52.6	20,418	1,769	0.00%	2,055	485	-2,540	-2,641	101
에코프로비엠	239,000	0.84	94.9	50.9	57,402	-3,867	-0.16%	2,754	681	-3,503	-3,633	0
삼성전자	72,300	3.14	909.0	49.9	1,206,466	-67,330	-0.10%	-55,956	37,462	17,357	18,270	-100
한국금융지주	55,600	2.21	4.4	49.5	21,627	147	0.02%	1,848	-1,321	-477	-424	-56
한국전력	18,550	-0.27	7.5	48.7	90,123	1,664	0.15%	2,288	363	-2,654	-2,994	379
삼성전기	149,100	3.69	41.8	47.9	14,664	1,557	0.12%	2,588	1,175	-3,758	-3,007	-745
삼성 SDI	719,000	4.05	69.3	47.0	12,856	-262	-0.04%	1,196	-328	-864	-517	-301

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터