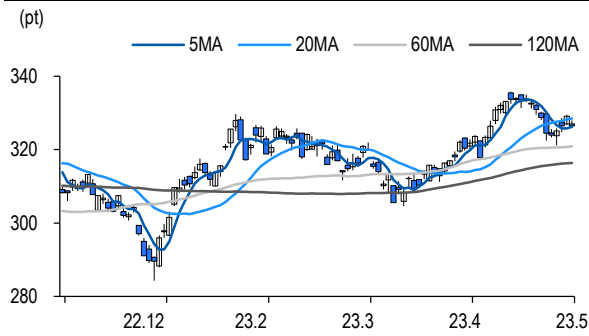


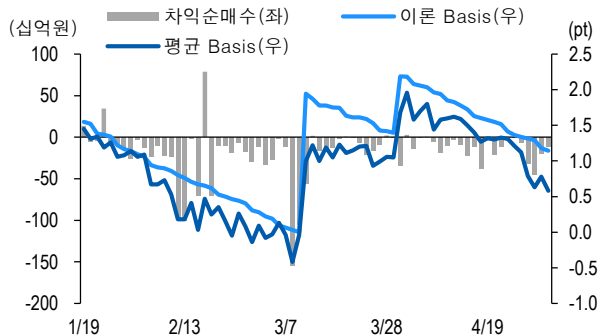
선물옵션시장 지표

2023.5.4

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	326.52	-0.78	-2.57	5,195.2	-
선물 6월물	326.80	-0.97	-3.20	15,359.5	316,695
선물 9월물	328.25	-1.03	-3.40	28.3	25,132
5월물(mini)	326.28	-0.94	-3.08	1,332.2	80,347
6월물(mini)	326.88	-0.95	-3.22	8.6	9,766

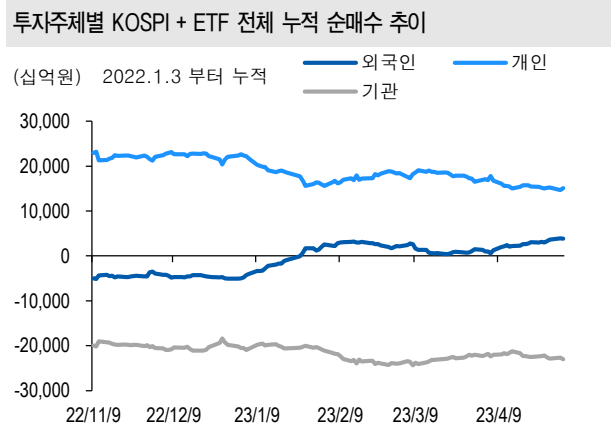


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	1.14	0.58	0.28	-0.17%
베이스스(mini)	0.25	0.03	-0.24	-0.07%
제1스프레드(SP)	2.00	1.49	1.45	-0.16%
합성선물 베이스스(ATM)	0.25	-0.23	-0.23	-0.15%

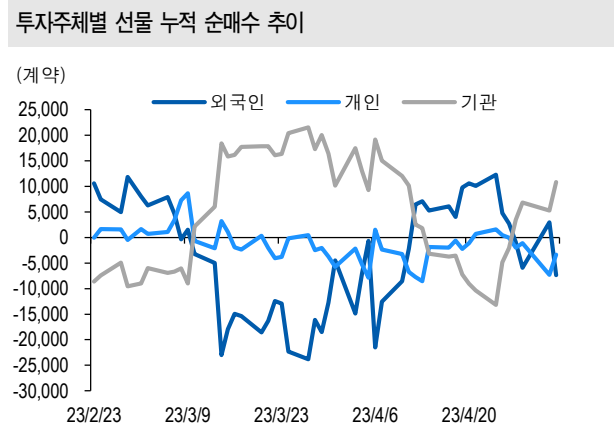


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-92.5	5.7	-86.9	0.0	-43.6	-982.8	136.6	-0.3	0.7	-19.2
개인	351.3	50.7	402.0	0.0	8.5	314.5	9.1	1.7	-1.0	-12.8
기관	-261.6	-63.6	-325.2	-11.1	-15.7	598.5	-145.3	-1.3	0.5	32.7
금융투자	-190.0	-133.6	-323.6	-10.3	4.6	797.9	-138.1	-0.9	0.4	31.2
투신	-24.6	8.0	-16.6	0.0	-13.0	-258.6	-7.5	-0.5	0.1	2.8
은행+보험+기타금융	2.2	17.4	19.6	0.0	2.4	19.9	0.3	0.0	0.0	-0.1
연기금+국가자자체	-20.0	6.6	-13.4	0.0	-4.2	39.3	0.0	0.0	0.0	-1.2
기타법인	2.9	6.9	9.7	0.0	1.4	69.8	-0.4	0.0	-0.2	-0.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	551,205	114.9	1,003,540	11.9%	지수옵션 전체	1,168,702	263.5	2,555,086			
Put	617,497	148.6	1,551,546	14.7%	PCR(금액기준)	1.29	VKOSPI	15.09%(+0.88%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	337.5(K+3)	0.10	-0.20	64,297	33,165	7,524	11.7	Put	332.5(K+1)	6.84	2.37	1,149	8,526	162	15.6
	335.0(K+2)	0.27	-0.41	101,260	35,164	1,132	11.9		330.0(K+0)	4.93	1.93	7,547	16,395	-207	14.9
	332.5(K+1)	0.59	-0.73	104,653	22,865	326	11.9		327.5(K-1)	3.33	1.43	27,626	14,382	1,133	14.5
	330.0(K+0)	1.22	-1.11	120,887	29,578	5,114	12.2		325.0(K-2)	2.16	1.02	81,113	20,783	829	14.6
	327.5(K-1)	2.15	-1.55	40,216	14,307	1,250	12.1		322.5(K-3)	1.32	0.67	106,552	20,515	1,108	14.7

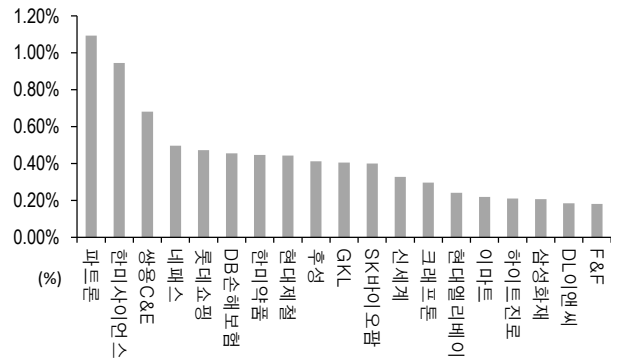
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,897,686	2,312.1	4,600,103	-44,637	-56,505	-2,691	59,379	-19.2	-12.8	32.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한세실업	16,700	-2.91	4.8	290.7	41,538	-5,115	-2.11%	-2,564	1,260	1,304	-1,396	0
삼성전자	65,400	-0.46	532.0	92.9	1,108,686	-2,163	-0.05%	-4,838	-5,085	9,841	12,397	-3,189
GKL	19,060	-0.57	5.8	80.5	19,134	3,652	0.41%	-2,102	664	1,438	-2,098	0
BGF	4,255	0.59	0.3	75.2	10,975	-587	-1.24%	-2,414	75	2,339	2,339	0
LG 화학	727,000	-2.94	86.4	74.3	9,080	-142	-0.02%	171	-189	32	144	-112
기아	86,700	-0.34	54.4	74.0	74,078	191	0.04%	241	-5,748	5,507	4,281	627
현대차	201,000	-0.50	66.4	72.3	56,003	904	0.10%	-386	-51	437	211	-276
넥센타이어	8,630	-0.12	0.8	71.5	3,444	-183	-0.48%	-2,592	-110	2,702	2,702	0
롯데에너지	59,900	-1.96	7.1	70.3	36,992	-2,857	-0.08%	-1,186	91	1,095	569	532
SK 하이닉스	89,700	-0.33	99.2	62.4	201,779	-3,633	-0.02%	3,313	-1,934	-1,115	-2,186	1,532

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터