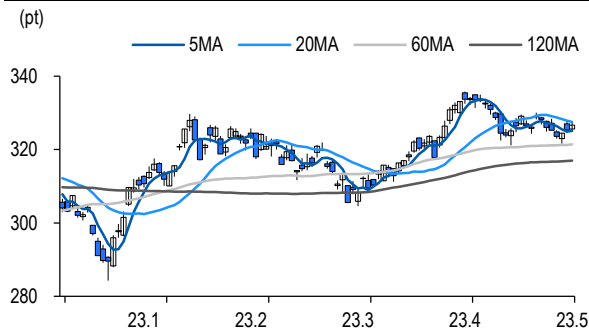


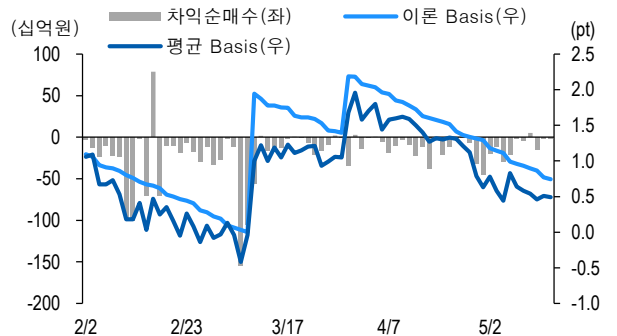
선물옵션시장 지표

2023.5.18

| 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 |

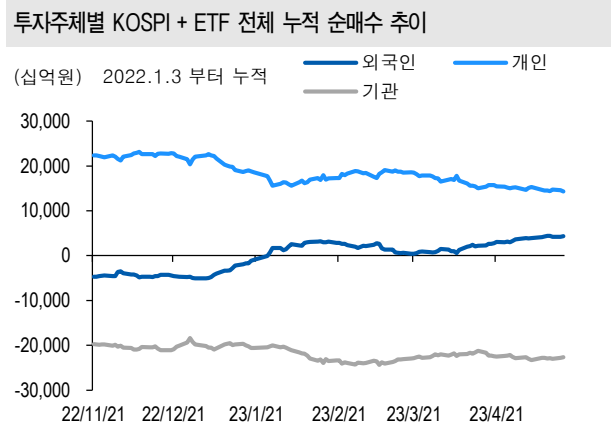


| 차익거래 관련 Market data (pt) | | | | |
|--------------------------|------|-------|-------|--------|
| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) |
| K200 베이스스 | 0.72 | 0.42 | -0.11 | -0.09% |
| 베이스스(mini) | 0.72 | 0.42 | -0.11 | -0.09% |
| 제1스프레드(SP) | 2.09 | 1.43 | 1.45 | -0.20% |
| 합성선물 베이스스(ATM) | 0.72 | -0.07 | -0.07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

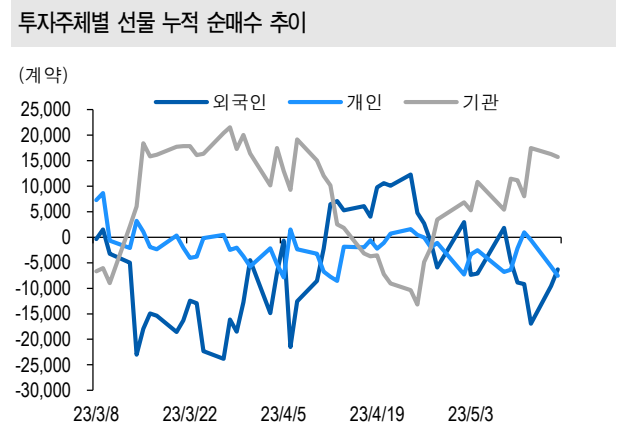


| 투자주체별 매매 동향 (십억원) | | | | | | | | | | |
|-------------------|--------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|
| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 |
| 외국인 | 158.0 | 30.2 | 188.2 | 0.4 | -3.2 | 459.5 | 18.0 | -0.1 | -2.1 | 27.5 |
| 개인 | -325.0 | -18.0 | -343.0 | 0.0 | 0.3 | -200.3 | -24.0 | -0.8 | -0.3 | 11.4 |
| 기관 | 157.4 | -2.9 | 154.5 | -7.0 | 6.5 | -247.8 | 4.9 | -0.2 | 1.6 | -37.0 |
| 금융투자 | 39.7 | 3.4 | 43.1 | -6.7 | 4.2 | -387.1 | 10.0 | -0.1 | 1.7 | -24.0 |
| 투신 | 36.1 | -1.5 | 34.6 | 0.0 | 4.2 | 151.0 | -3.9 | -0.2 | -0.1 | -10.2 |
| 은행+보험+기타금융 | 17.4 | -2.0 | 15.4 | 0.0 | -0.5 | -4.7 | -1.2 | 0.0 | 0.0 | -0.1 |
| 연기금+국가자재 | 57.8 | -3.1 | 54.7 | 0.8 | 0.6 | -7.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -2.7 |
| 기타법인 | 9.5 | 1.5 | 11.0 | 0.0 | 0.1 | -11.4 | 1.1 | 1.2 | 0.8 | -1.9 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



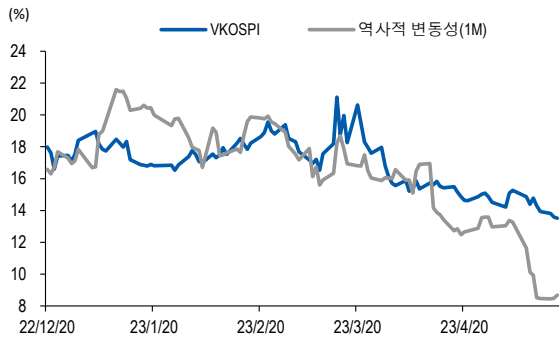
선물옵션시장 지표

| 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 |

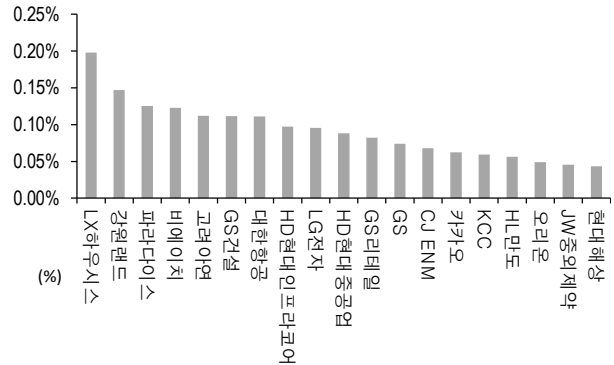
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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