

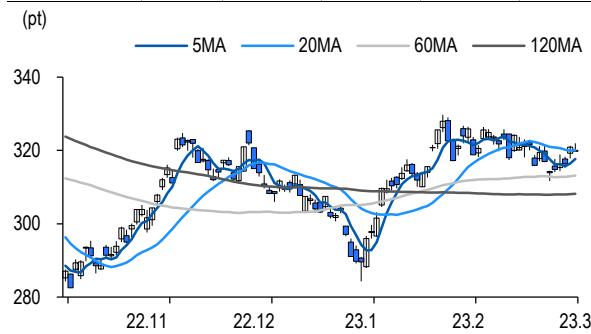


## 선물옵션시장 지표

2023.3.8

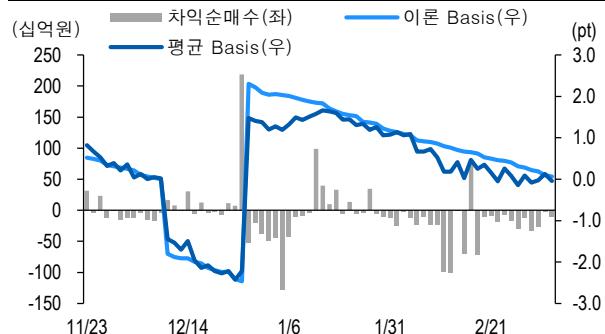
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	319.80	-0.36	-1.14	7,451.0	-
선물 3월물	319.40	-0.50	-1.60	15,394.4	164,304
선물 6월물	320.95	-0.56	-1.80	2,932.2	190,597
3월물(mini)	319.40	-0.50	-1.60	1,218.9	52,338
4월물(mini)	319.30	-0.50	-1.60	46.2	19,325



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.06	-0.04	-0.40	-0.03%
베이시스(mini)	0.06	-0.05	-0.40	-0.04%
제1스프레드(SP)	2.07	1.52	1.50	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.06	-0.37	-0.37	-0.14%



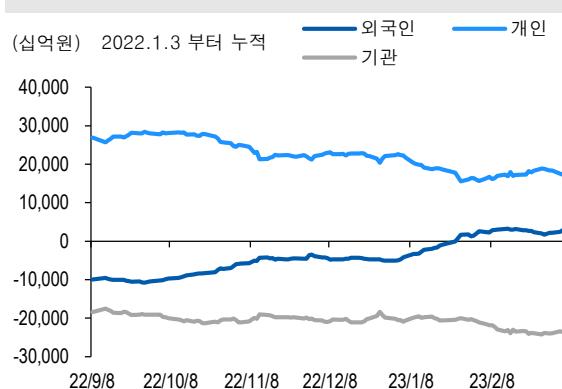
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	334.1	25.4	359.5	0.1	129.3	-205.4	-62.8	1.8	2.5	-11.2
개인	-215.2	-10.9	-226.1	0.0	0.0	158.9	29.8	-0.6	-4.4	54.2
기관	-135.4	-37.7	-173.1	-10.9	13.5	-4.4	31.3	-0.8	2.8	-45.6
금융투자	-285.1	76.0	-209.1	-4.7	9.3	184.0	31.7	-1.2	2.9	-51.2
투신	69.1	5.1	74.3	0.0	14.3	-184.5	-0.2	-0.1	0.0	5.6
은행+보험+기타금융	15.4	-154.7	-139.2	0.0	-9.6	-6.7	-0.2	0.5	-0.1	0.0
연기금+국가지자체	66.7	31.7	98.4	-1.6	12.8	2.8	0.0	0.0	0.0	0.1
기타법인	16.5	-0.9	15.6	0.0	-1.6	50.9	1.6	-0.4	-0.9	2.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	1,131,041	245.5	1,106,668	14.4%	지수옵션 전체		2,084,345	435.2	2,744,111		
Put	953,304	189.7	1,637,443	17.9%	PCR(금액기준)		0.77	VKOSPI	16.95%(-0.23%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	327.5(K+3)	0.06	-0.21	184,611	40,296	2,062	14.4	322.5(K+1)	3.75	0.67	37,905
	325.0(K+2)	0.24	-0.46	294,987	37,101	3,009	14.6	320.0(K+0)	2.16	0.35	153,914
	322.5(K+1)	0.68	-0.77	254,427	31,227	4,255	14.4	317.5(K-1)	1.07	0.09	201,499
	320.0(K+0)	1.59	-1.13	123,024	29,504	1,062	14.2	315.0(K-2)	0.47	-0.01	190,230
	317.5(K-1)	2.98	-1.30	19,560	21,851	-283	12.9	312.5(K-3)	0.17	-0.05	131,817
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	322.5(K+1)	3.75	0.67	37,905	10,727	1,748	19.0	320.0(K+0)	2.16	0.35	153,914
	320.0(K+0)	2.16	0.35	153,914	24,686	3,023	18.2	317.5(K-1)	1.07	0.09	201,499
	317.5(K-1)	1.07	0.09	201,499	24,640	1,756	17.8	315.0(K-2)	0.47	-0.01	190,230
	315.0(K-2)	0.47	-0.01	190,230	37,227	3,008	17.9	312.5(K-3)	0.17	-0.05	131,817
	312.5(K-3)	0.17	-0.05	131,817	34,501	-110	17.9				

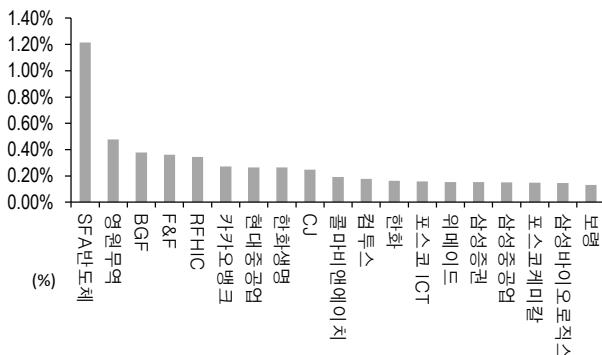
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

											(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	개인	기관	금융투자	연기금등
주식선물 전체	3,190,435	3,091.8	4,727,332	78,346	11,936	68,712	-76,666	-11.2	54.2	-45.6				
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수
SK 하이닉스	88,800	-1.00	109.2	78.3	97,347	-31,291	-0.01%	-3,635	2,657	998	498	947		
현대차	175,200	-1.46	48.2	59.3	21,770	-3,463	0.00%	-193	850	-661	-625	-36		
삼성전자	60,800	-0.98	401.8	57.6	522,302	-180,197	0.02%	159	20,690	-20,982	-18,563	-1,464		
삼성전기	151,200	-1.18	26.0	53.4	9,048	-1,933	-0.16%	-3,417	775	2,657	2,269	388		
LG 전자	114,700	0.00	39.5	46.4	35,425	-994	0.10%	-2,253	4,475	-2,402	-814	-2,448		
NAVER	211,000	-2.31	60.4	44.7	22,397	-10,746	0.07%	92	896	-988	-1,840	702		
한국조선해양	79,000	-1.62	7.3	44.7	8,702	2,899	-0.33%	2,030	-5,841	3,811	3,811	0		
롯데케미칼	185,600	0.87	8.4	44.3	5,851	-530	0.05%	536	62	-598	-656	-115		
LG 화학	741,000	2.07	113.9	41.1	6,134	-1,204	0.02%	395	-216	-178	-251	29		
현대건설	36,700	0.00	5.2	38.0	13,019	-1,853	0.04%	1,213	378	-1,591	-1,190	-401		

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터