

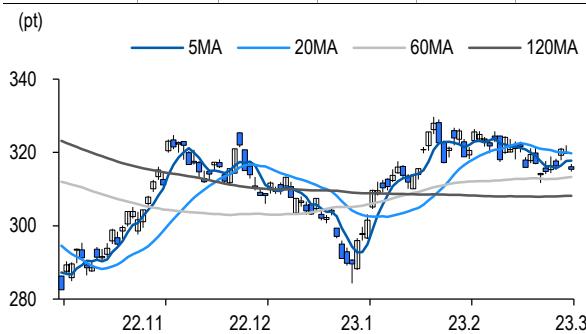


선물옵션시장 지표

2023.3.9

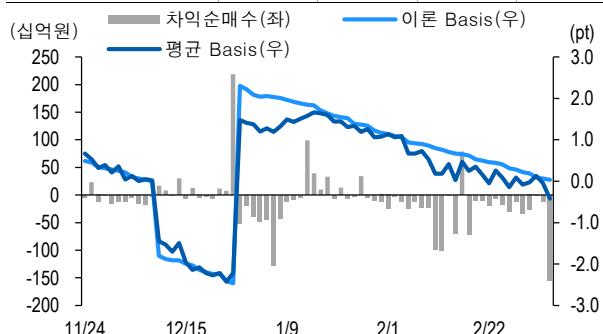
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	315.38	-1.38	-4.42	7,031.4	-
선물 3월물	314.65	-1.49	-4.75	15,783.7	118,144
선물 6월물	315.70	-1.64	-5.25	5,211.3	256,750
3월물(mini)	314.88	-1.42	-4.52	1,157.8	53,451
4월물(mini)	314.68	-1.45	-4.62	129.2	23,458



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.03	-0.42	-0.73	-0.14%
베이시스(mini)	0.03	-0.42	-0.50	-0.14%
제1스프레드(SP)	2.02	1.45	1.40	-0.18%
합성선물 베이시스(ATM)	0.03	-0.69	-0.69	-0.23%



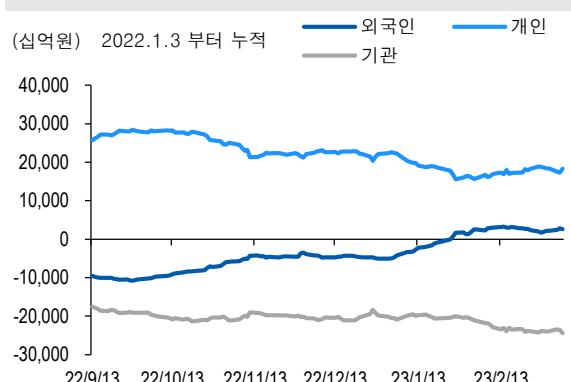
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-154.8	-15.7	-170.4	0.0	-263.2	-351.5	-42.7	-1.9	5.1	-38.0
개인	943.1	-15.9	927.1	0.0	1.1	274.7	30.0	-0.7	-1.9	78.7
기관	-820.1	25.4	-794.7	-154.5	-82.9	40.8	12.0	3.7	-2.6	-41.4
금융투자	-771.7	-51.5	-823.1	-127.0	-74.4	482.8	12.0	2.7	-1.5	-54.3
투신	-17.1	14.9	-2.3	0.0	-9.3	-383.0	0.3	-0.2	0.0	5.4
은행+보험+기타금융	8.7	1.5	10.2	0.0	0.8	-54.6	-0.3	1.3	-1.1	0.2
연기금+국가지자체	19.1	24.2	43.4	0.0	9.0	-4.5	0.0	0.0	0.0	7.4
기타법인	31.9	6.3	38.2	0.0	0.8	36.0	0.8	-1.1	-0.6	0.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

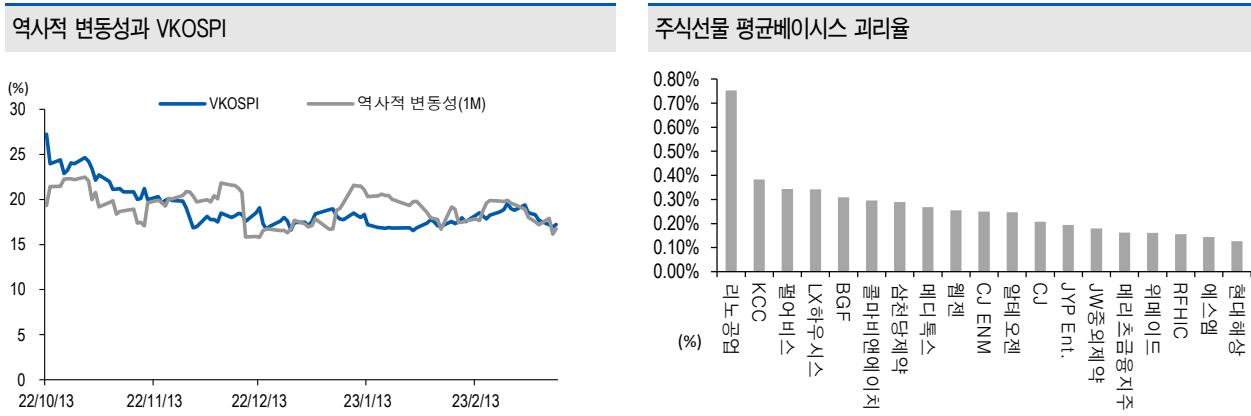
투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	1,378,187	216.9	1,188,140	12.5%	지수옵션 전체		2,576,381	499.7	2,875,438		
Put	1,198,194	282.8	1,687,298	17.8%	PCR(금액기준)		1.30	VKOSPI	17.21% (+0.26%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	327.5(K+3)	0.01	-0.05	62,836	46,314	6,018	20.3	322.5(K+1)	7.93	4.18	3,292
	325.0(K+2)	0.01	-0.23	98,487	32,418	-4,683	16.6	320.0(K+0)	5.38	3.22	21,752
	322.5(K+1)	0.03	-0.65	176,812	39,164	7,937	14.9	317.5(K-1)	3.12	2.05	86,389
	320.0(K+0)	0.07	-1.52	329,058	46,676	17,172	12.3	315.0(K-2)	1.46	0.99	294,157
	317.5(K-1)	0.33	-2.65	383,429	38,416	16,565	11.3	312.5(K-3)	0.53	0.36	319,224
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	322.5(K+1)	7.93	4.18	3,292	10,385	-342	34.6	320.0(K+0)	5.38	3.22	23,136
	320.0(K+0)	5.38	3.22	21,752	23,136	-1,550	26.2	317.5(K-1)	3.12	2.05	86,389
	317.5(K-1)	3.12	2.05	86,389	20,541	-4,099	20.5	315.0(K-2)	1.46	0.99	294,157
	315.0(K-2)	1.46	0.99	294,157	31,550	-5,677	18.0	312.5(K-3)	0.53	0.36	319,224
	312.5(K-3)	0.53	0.36	319,224	35,069	568	17.1				

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
주식선물 전체	3,621,783	2,911.1	4,827,656	100,324	-26,070	111,846	-84,863	-38.0	78.7	-41.4				
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인	개인	기관	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	175,000	-0.11	63.3	73.9	11,791	-9,979	0.01%	139	858	-1,003	-1,845	-100		
삼성전자	60,400	-0.66	426.5	51.0	379,689	-142,613	-0.02%	-2,740	57,944	-55,209	-53,924	2,000		
SK 하이닉스	86,800	-2.25	121.5	50.6	70,341	-27,006	0.02%	-5,119	12,893	-7,754	-3,588	-1,744		
한국조선해양	78,100	-1.14	9.4	50.2	6,181	-2,521	0.06%	-3,287	5,680	-2,510	-2,071	-439		
LG 전자	117,800	2.70	100.7	49.6	33,096	-2,329	0.10%	4,345	1,706	-5,954	-4,291	-661		
삼성전기	152,100	0.60	20.5	44.8	8,108	-940	-0.17%	-598	-981	1,583	293	-213		
LG 디스플레이	15,160	-0.72	5.8	44.2	48,865	-8,956	0.07%	4,701	1,977	-6,678	-7,459	780		
LG 화학	713,000	-3.78	65.7	42.1	4,281	-1,853	-0.01%	-857	541	315	-44	251		
롯데케미칼	179,900	-3.07	7.4	41.9	3,862	-1,989	-0.01%	-361	-366	747	585	162		
카카오페이	59,600	-3.40	17.5	41.2	32,895	-7,875	-0.24%	-1,083	-2,479	3,562	-2,012	-151		

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터