

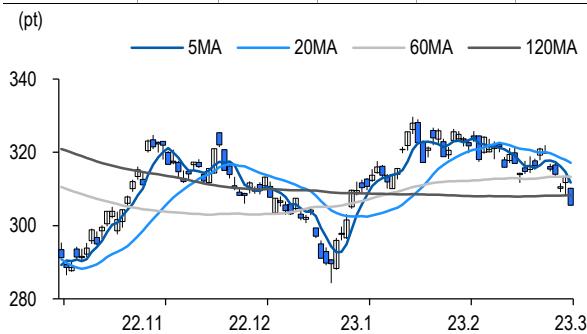


선물옵션시장 지표

2023.3.15

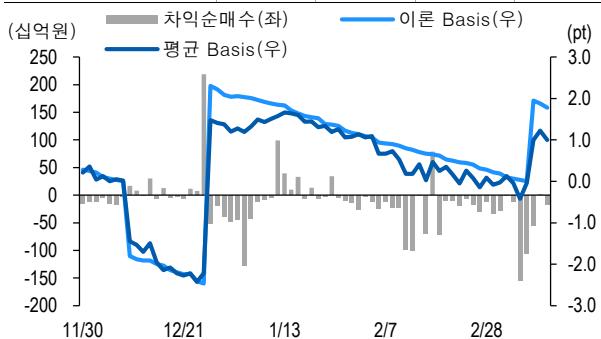
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	305.58	-2.44	-7.63	5,572.1	-
선물 6월물	306.90	-2.31	-7.25	24,299.9	328,291
선물 9월물	308.10	-2.33	-7.35	31.8	19,974
4월물(mini)	305.76	-2.28	-7.12	1,268.1	56,447
5월물(mini)	306.06	-2.47	-7.74	6.7	2,869



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.78	1.00	1.32	-0.25%
베이시스(mini)	0.09	-0.14	0.18	-0.08%
제1스프레드(SP)	1.88	1.30	1.30	-0.19%
합성선물 베이시스(ATM)	0.09	0.25	0.25	0.05%



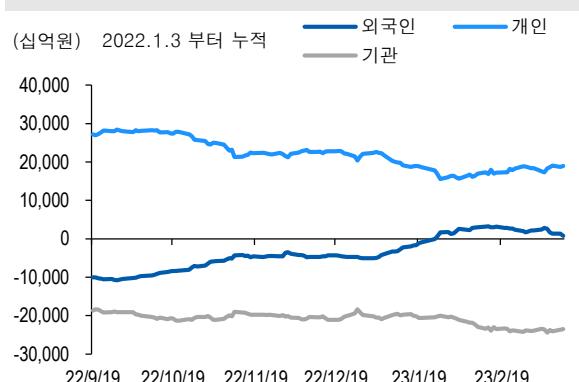
투자주체별 매매 동향

(십억원)

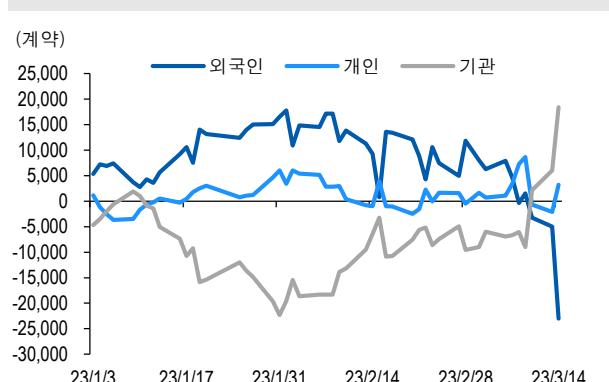
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-638.3	34.4	-603.9	0.0	-511.4	-1,421.1	21.8	-18.5	2.7	1.0
개인	564.8	-267.3	297.5	0.0	-1.2	382.3	34.3	2.7	3.5	-34.6
기관	26.2	201.8	228.0	-16.5	-10.7	1,017.7	-57.1	16.0	-6.6	33.8
금융투자	55.5	172.7	228.2	-10.4	-3.3	1,588.8	-55.7	17.6	-6.5	58.1
투신	-11.1	-37.2	-48.3	-0.1	-0.1	-551.1	-1.3	0.0	0.1	-21.4
은행+보험+기타금융	30.5	35.3	65.8	0.0	8.5	-36.3	-0.1	-1.6	-0.2	0.4
연기금+국가지자체	58.0	30.6	88.6	-1.5	-0.7	16.2	0.0	0.0	0.0	-3.2
기타법인	47.4	29.8	77.2	0.0	-1.8	21.1	1.0	-0.1	0.5	-0.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



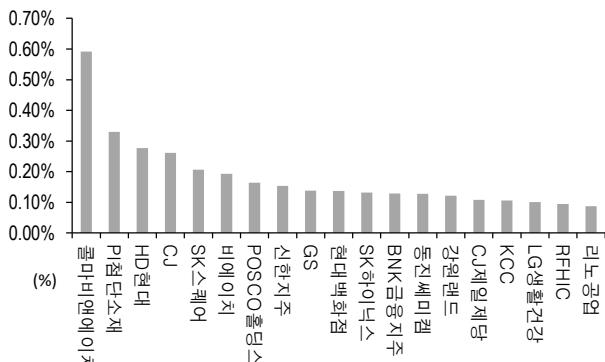
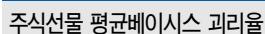
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	526,339	196.1	737,035	18.4%	지수옵션 전체	1,123,401	475.6	1,816,352							
Put	597,062	279.4	1,079,317	19.4%	PCR(금액기준)	1.42	VKOSPI	21.11%(+2.91%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	1.78	-1.40	56,508	23,968	6,217	18.2	Put	315.0(K+1)	12.25	4.94	626	7,452	148	18.4
	317.5(K+2)	2.40	-1.73	45,069	11,353	3,704	18.6		312.5(K+0)	10.60	4.53	2,887	3,509	357	18.6
	315.0(K+1)	3.08	-2.16	26,031	11,172	2,322	18.7		310.0(K-1)	9.13	4.14	6,123	12,475	77	19.0
	312.5(K+0)	3.93	-2.56	12,171	3,749	1,184	18.9		307.5(K-2)	7.76	3.69	7,592	7,300	290	19.2
	310.0(K-1)	4.93	-2.96	8,178	6,266	1,422	19.2		305.0(K-3)	6.56	3.23	13,314	13,106	-1,034	19.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	3,247,169	2,274.5	4,080,681	19,271	17,402	-69,676	52,302	1.0	-34.6	33.8		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균과리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
메리츠증권	6,370	-5.49	8.7	89.0	70,304	8,857	-0.20%	2,691	-7,323	4,632	4,622	0
현대차	171,400	-3.00	82.7	81.7	30,771	1,201	-0.06%	394	-9	-374	-579	-498
넷마블	56,900	1.61	13.1	74.3	6,367	24	-0.22%	-476	451	25	4	24
CJ	94,000	-0.21	7.0	70.5	19,918	3,678	0.26%	-774	3,486	-2,712	-2,865	164
삼성전기	150,500	-1.57	37.7	60.1	11,763	-269	-0.13%	-1,958	2,028	-5	251	-257
일진머티리얼즈	62,100	-4.61	12.7	59.4	43,962	-17	-0.10%	1,243	-1,557	314	-42	356
LG 화학	708,000	-1.53	73.9	55.7	8,391	12	-0.01%	123	-240	116	303	-173
SK 하이닉스	80,900	-3.92	142.1	53.4	178,166	10,888	0.13%	-2,701	8,488	-5,702	-853	-449
삼성 SDI	719,000	-2.57	104.6	53.4	13,169	-474	-0.12%	535	-595	65	707	-186
삼성전자	58,900	-1.67	354.6	53.3	1,111,050	-3,166	0.03%	-2,593	-9,544	12,375	14,504	1,900

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터