

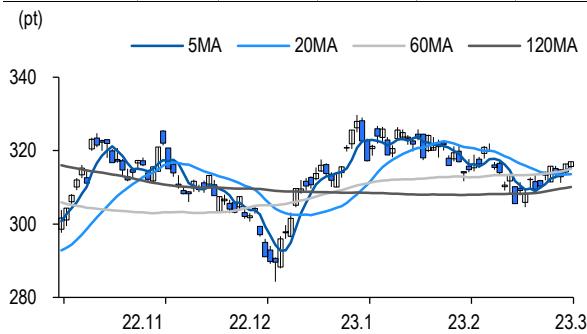


선물옵션시장 지표

2023.3.30

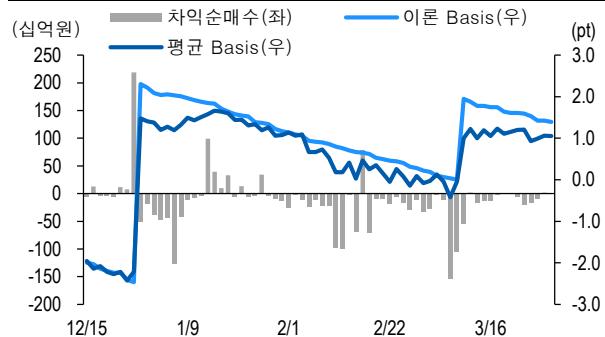
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	317.01	0.21	0.65	5,794.0	-
선물 6월물	317.90	0.14	0.45	14,432.3	305,361
선물 9월물	319.25	0.14	0.45	14.0	19,697
4월물(mini)	316.58	0.17	0.54	1,165.5	74,731
5월물(mini)	317.44	0.17	0.54	2.6	9,287



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.39	1.05	0.89	-0.11%
베이시스(mini)	-0.35	-0.28	-0.43	0.02%
제1스프레드(SP)	1.97	1.45	1.45	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.35	-0.36	-0.36	0.00%



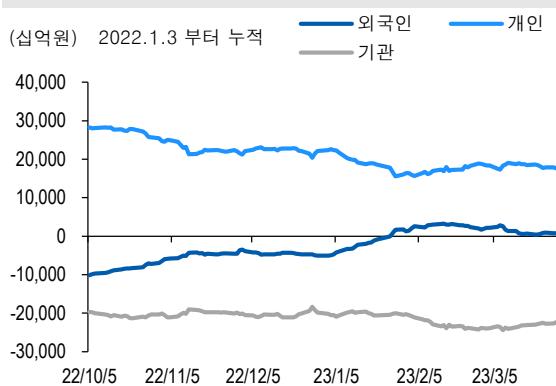
투자주체별 매매 동향

(십억원)

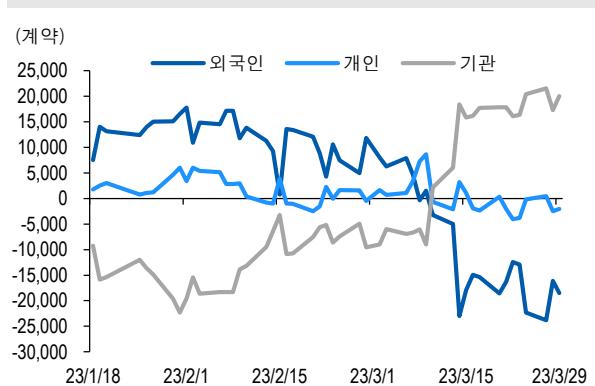
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	2.3	25.5	27.8	0.0	164.5	-297.8	108.3	-3.2	-0.1	16.3
개인	-328.4	-15.8	-344.3	0.0	-4.6	41.4	-4.3	2.9	-2.1	-6.3
기관	327.0	-10.3	316.7	-0.9	-27.4	322.6	-104.1	-0.2	1.6	-9.0
금융투자	203.2	32.5	235.7	0.0	1.0	266.9	-103.5	-0.2	1.7	-12.7
투신	17.5	-15.0	2.6	0.0	-5.3	31.2	-0.7	0.0	0.0	0.9
은행+보험+기타금융	0.7	1.5	2.2	0.0	-1.8	13.2	0.1	0.0	-0.1	0.1
연기금+국가지자체	40.9	-14.4	26.5	0.0	-10.7	11.3	0.0	0.0	0.0	2.8
기타법인	-0.8	-4.1	-4.9	0.0	-0.7	-66.2	0.0	0.4	0.5	-1.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	457,746	125.7	939,117	14.0%	지수옵션 전체	988,410	251.7	2,388,147
Put	530,664	126.0	1,449,030	15.4%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	16.15%(-0.66%p)
<hr/>								
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	325.0(K+3)	0.96	0.00	103,175	35,547	1,685	13.9	320.0(K+1)
	322.5(K+2)	1.57	0.06	67,444	21,113	110	14.2	317.5(K+0)
	320.0(K+1)	2.42	0.05	62,711	28,309	668	14.5	315.0(K-1)
	317.5(K+0)	3.49	0.03	24,739	19,833	-144	14.7	312.5(K-2)
	315.0(K-1)	4.79	0.04	7,802	16,394	-186	14.7	310.0(K-3)
<hr/>								
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	320.0(K+1)	5.73	-0.56	1,990	6,306	143	14.5	320.0(K+1)
	317.5(K+0)	4.34	-0.52	4,468	3,501	236	14.8	317.5(K+0)
	315.0(K-1)	3.14	-0.56	15,991	13,268	895	14.9	315.0(K-1)
	312.5(K-2)	2.23	-0.50	30,444	10,544	1,037	15.2	312.5(K-2)
	310.0(K-3)	1.54	-0.44	47,955	19,738	711	15.4	310.0(K-3)

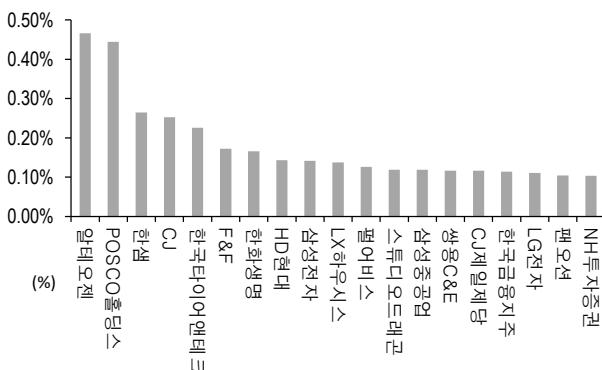
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,297,976	2,001.0	4,443,980	3,375	-16,355	-8,247	25,315	16.3	-6.3	-9.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
영진약품	2,880	-2.54	1.2	121.9	5,836	-1,470	-0.17%	-2,712	192	2,520
JW 중외제약	20,400	-1.45	1.3	81.8	2,248	245	-0.02%	483	89	-572
넥센타이어	7,880	-0.25	1.0	77.5	5,381	-2,053	-0.08%	2,298	-102	-2,196
현대차	180,600	2.15	65.8	64.5	31,199	2,481	0.00%	3,061	-493	-2,571
NAVER	199,400	-0.10	54.4	62.3	24,833	-1,268	-0.03%	-611	-207	816
한울바이오파마	18,290	-0.92	1.6	56.2	10,530	-536	-0.38%	985	-978	-7
에스엠	97,500	3.28	44.7	55.0	89,292	-11,758	-0.30%	2,031	-4,015	2,462
삼성전자	62,500	0.00	367.2	53.1	1,089,542	-18,478	0.14%	9,121	3,463	-12,728
넷마블	65,300	0.31	7.6	53.1	7,072	-198	-0.16%	-1,181	-43	1,224
SK 하이닉스	86,900	-1.47	139.9	52.7	187,036	-10,855	0.08%	-4,202	-2,052	7,151

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터