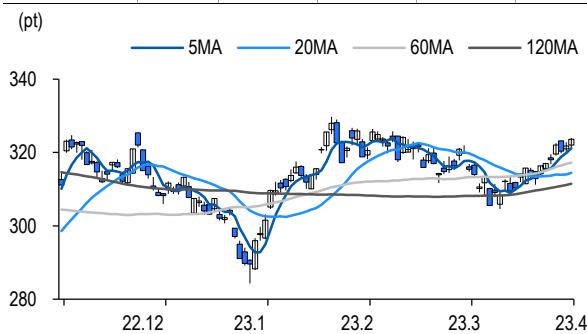


선물옵션시장 지표

2023.4.6

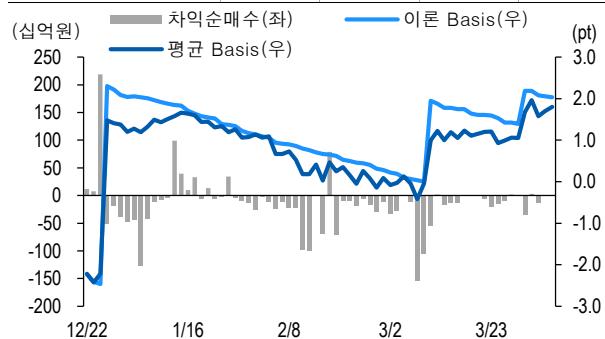
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	323.56	0.56	1.81	6,521.7	-
선물 6월물	325.75	0.63	2.05	16,082.8	323,047
선물 9월물	327.20	0.71	2.30	12.9	20,258
4월물(mini)	324.20	0.65	2.10	1,338.0	91,654
5월물(mini)	324.76	0.61	1.98	14.2	10,172



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.04	1.80	2.19	-0.07%
베이시스(mini)	0.25	0.29	0.64	0.01%
제1스프레드(SP)	2.04	1.50	1.50	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.25	0.67	0.67	0.13%



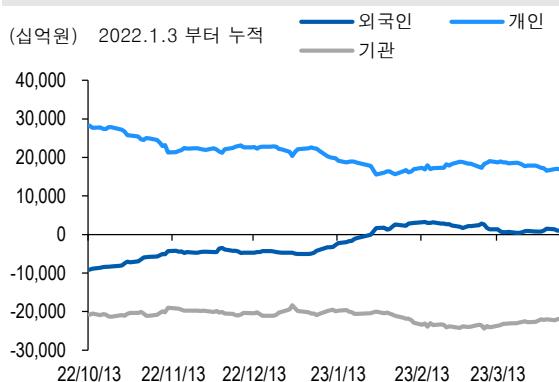
투자주체별 매매 동향

(십억원)

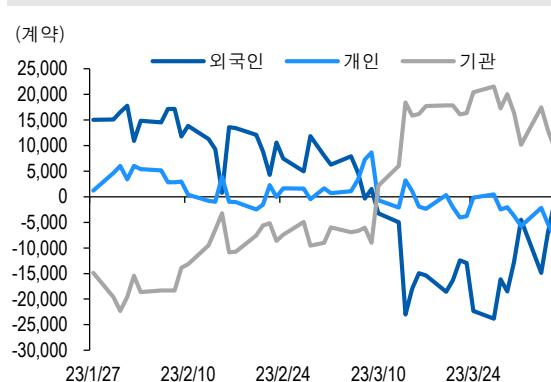
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-18.8	4.6	-14.2	0.2	179.1	610.9	-95.8	-5.7	-1.0	11.9
개인	-275.8	60.5	-215.3	0.0	0.6	-198.7	-10.1	7.4	0.3	22.6
기관	301.0	-59.9	241.1	0.0	-24.9	-405.6	105.4	-1.6	1.5	-35.1
금융투자	329.3	-45.4	283.8	0.1	-1.0	-321.1	105.4	-1.8	1.5	-24.0
투신	25.4	-1.0	24.3	0.0	-3.1	-100.6	-0.1	0.1	0.0	-11.2
은행+보험+기타금융	-0.7	-0.8	-1.5	0.0	-3.1	19.5	0.2	0.0	0.0	-0.1
연기금+국가지자체	-31.2	-5.1	-36.3	0.0	-15.0	-3.4	0.0	0.0	0.0	0.1
기타법인	-6.4	-8.9	-15.4	0.0	1.1	-6.5	0.5	-0.1	-0.9	0.7

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	560,351	150.0	997,780	14.2%	지수옵션 전체	1,188,514	278.0	2,695,499
Put	628,163	128.0	1,697,719	14.4%	PCR(금액기준)	0.85	VKOSPI	15.36%(+0.14%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	330.0(K+3)	0.77	0.31	107,183	35,397	-3,128	13.9	Put
	327.5(K+2)	1.43	0.49	108,496	29,350	-48	14.2	
	325.0(K+1)	2.43	0.68	72,502	30,538	791	14.6	
	322.5(K+0)	3.86	1.16	27,826	21,391	747	15.5	
	320.0(K-1)	5.56	1.35	18,461	29,930	2,115	16.3	

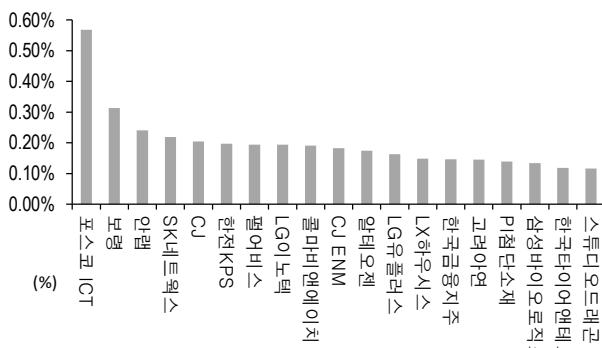
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,555,129	2,314.9	4,666,064	19,660	-27,634	-1,718	28,476	11.9	22.6	-35.1
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	8,330	0.85	1.6	98.6	11,685	-3,495	0.01%	4,019	-456	-3,563
현대차	187,200	1.74	68.7	72.6	29,618	-1,961	-0.02%	538	-1,368	842
LG 화학	734,000	1.66	82.2	67.1	7,443	-470	-0.04%	925	-1,176	255
현대건설	37,300	-0.27	6.5	55.7	17,983	1,120	-0.04%	-4,418	1,680	2,738
포스코퓨처엠	292,500	3.36	119.2	51.4	16,884	-839	0.00%	809	-842	153
SK 이노베이션	179,600	-1.32	67.3	50.3	18,221	215	0.04%	21	145	-143
대상	19,420	-1.42	0.9	49.8	3,901	-1,261	-0.02%	-1,143	-99	1,242
에스엠	96,200	0.00	19.5	49.6	72,149	-1,313	-0.22%	-155	1,845	-1,689
삼성 SDI	777,000	6.88	176.8	49.5	14,108	1,995	0.10%	1,877	521	-2,448
기아	81,600	1.87	39.7	48.4	41,686	1,421	-0.02%	2,434	777	-3,232

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터