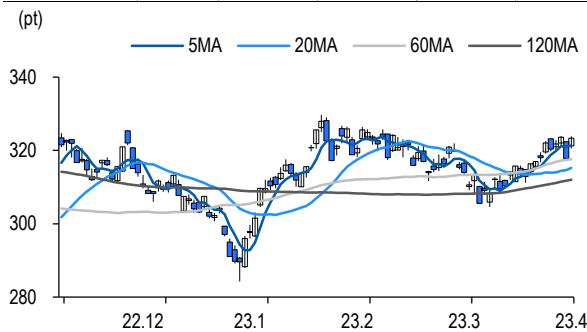


선물옵션시장 지표

2023.4.10

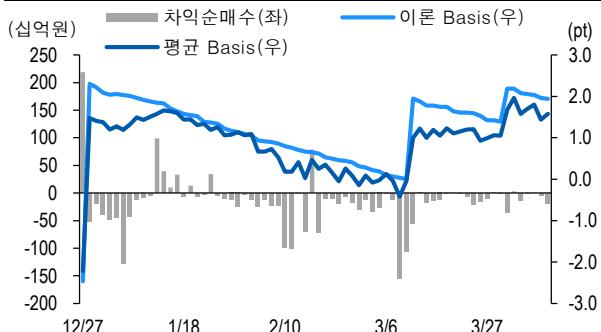
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	323.36	1.74	5.54	7,756.1	-
선물 6월물	324.85	1.59	5.10	14,878.7	316,953
선물 9월물	326.40	1.63	5.25	22.2	20,526
4월물(mini)	323.32	1.56	4.96	1,337.3	90,596
5월물(mini)	324.12	1.58	5.04	30.7	11,605



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.94	1.58	1.49	-0.11%
베이시스(mini)	0.19	0.12	-0.04	-0.02%
제1스프레드(SP)	2.04	1.44	1.45	-0.18%
합성선물 베이시스(ATM)	0.19	-0.03	-0.03	-0.07%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	693.8	6.5	700.3	0.0	755.7	887.7	-165.1	1.8	1.3	17.8
개인	-997.0	-23.4	-1,020.4	0.0	1.5	-285.6	-25.1	-1.2	-1.3	90.1
기관	287.6	46.6	334.2	-18.6	-16.7	-523.9	190.5	-1.5	0.4	-108.0
금융투자	123.8	55.8	179.5	-16.2	3.1	-1,125.9	189.8	-1.5	0.5	-101.1
투신	71.0	-5.2	65.8	0.0	25.8	593.7	0.7	0.1	-0.1	-4.2
은행+보험+기타금융	19.2	-27.2	-7.9	0.0	-5.6	12.3	0.0	-0.1	-0.1	-0.1
연기금+국가지자체	14.7	16.7	31.4	-0.1	-24.6	-4.0	0.0	0.0	0.0	-2.6
기타법인	15.6	-27.9	-12.3	0.0	1.1	-78.2	-0.3	0.9	-0.4	0.1

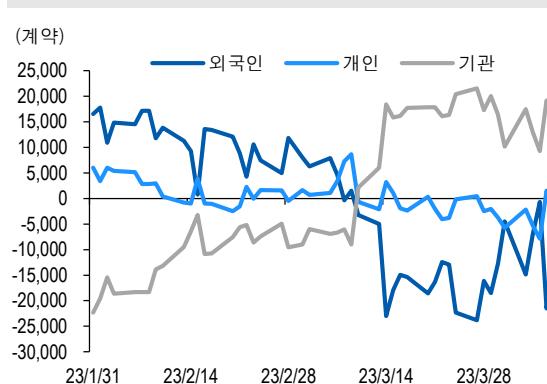
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



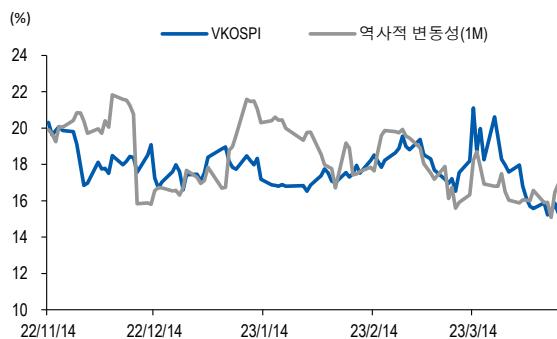
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	1,112,233	273.7	1,044,550	12.4%	지수옵션 전체	2,079,808	433.1	2,819,241							
Put	967,575	159.4	1,774,691	14.4%	PCR(금액기준)	0.58	VKOSPI	15.35%(-0.52%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	325.0(K+3)	1.61	1.09	198,842	31,514	-7,190	12.6	Put	320.0(K+1)	1.13	-2.27	131,990	26,342	6,589	14.2
	322.5(K+2)	2.80	1.74	100,402	19,800	-4,499	12.4		317.5(K+0)	0.55	-1.66	176,807	25,876	7,553	14.1
	320.0(K+1)	4.36	2.45	39,349	27,939	-2,498	11.8		315.0(K-1)	0.25	-1.09	153,322	36,765	10,186	14.2
	317.5(K+0)	6.38	3.21	8,130	20,624	-788	11.6		312.5(K-2)	0.11	-0.63	112,817	36,340	6,584	14.6
	315.0(K-1)	8.51	3.73	4,468	14,854	-924	1.2		310.0(K-3)	0.05	-0.36	95,028	43,191	10,927	15.1

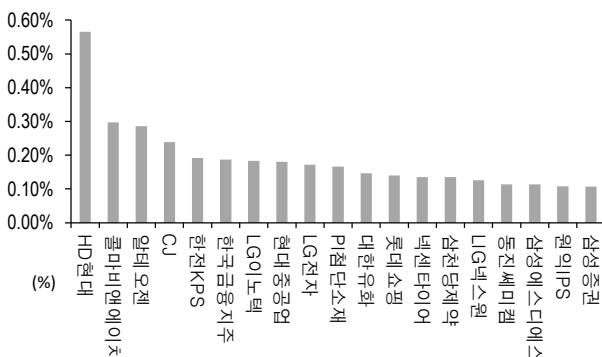
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,645,034	2,944.3	4,797,625	117,046	-18,727	107,767	-87,953	17.8	90.1	-108.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	8,130	-1.69	1.3	83.1	7,728	-3,385	0.14%	5,037	619	-5,656
현대차	184,900	-0.11	52.3	65.0	28,802	-733	-0.02%	-3,542	-111	3,837
영진약품	3,030	0.17	0.6	63.9	5,120	590	-0.07%	566	-71	-495
하나금융지주	40,950	1.36	13.0	57.0	71,797	207	0.05%	3,764	500	-4,271
SK 이노베이션	183,500	4.32	156.7	50.1	19,384	2,391	0.08%	-1,281	2,229	-923
LG 화학	717,000	0.00	58.2	46.4	6,267	-992	0.03%	138	-253	118
대상	19,130	-1.80	0.7	46.3	5,011	1,049	-0.16%	-1,365	99	1,266
한국조선해양	77,400	-0.39	5.0	44.6	7,241	225	0.04%	-231	328	-96
SK	171,300	1.12	7.7	43.7	6,066	-18	0.02%	-634	40	594
NAVER	193,500	0.78	44.9	43.7	22,623	-1,663	0.00%	3,203	61	-3,264

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터