

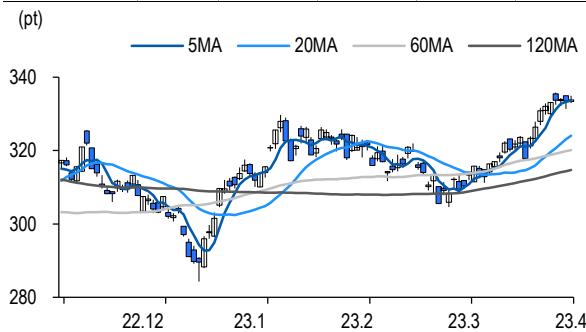


선물옵션시장 지표

2023.4.20

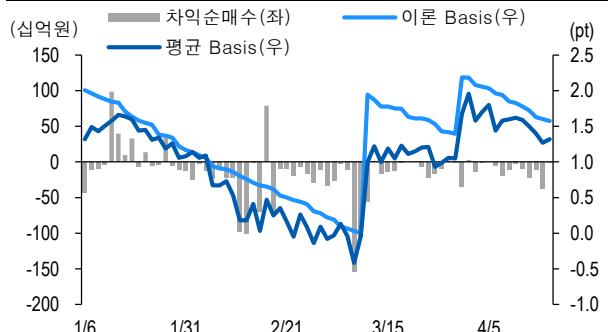
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	333.77	0.08	0.27	7,818.0	-
선물 6월물	335.10	-0.01	-0.05	14,385.7	323,163
선물 9월물	336.50	-0.01	-0.05	12.8	22,680
5월물(mini)	334.32	-0.02	-0.08	1,177.9	46,398
6월물(mini)	335.00	-0.05	0.00	5.6	9,389



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.58	1.32	1.33	-0.08%
베이시스(mini)	0.69	0.56	0.55	-0.04%
제1스프레드(SP)	2.01	1.54	1.55	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.69	0.52	0.52	-0.05%



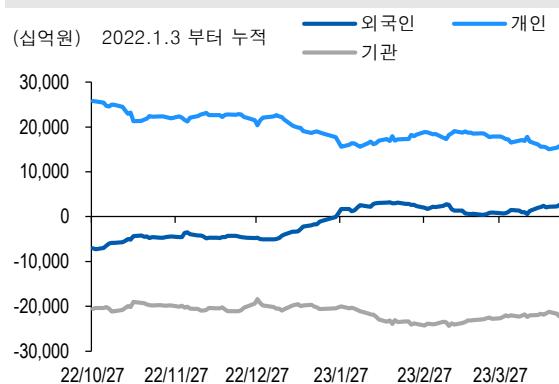
투자주체별 매매 동향

(십억원)

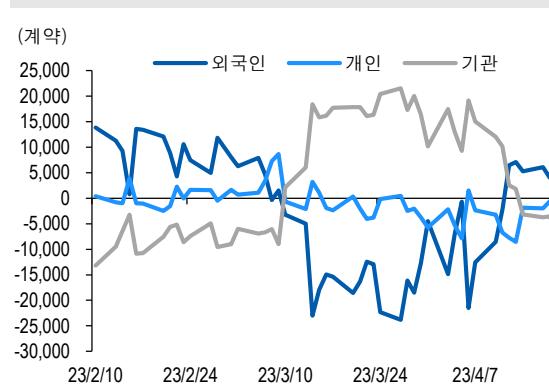
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-19.7	20.2	0.5	0.0	-10.0	535.1	-53.5	-2.3	0.1	-14.8
개인	-36.9	11.8	-25.1	0.0	-5.6	-150.3	15.6	-0.7	1.1	-13.2
기관	44.9	-46.5	-1.6	-0.6	-61.2	-350.3	37.3	3.1	-1.1	29.0
금융투자	50.0	64.2	114.2	-0.3	4.1	-382.5	36.4	1.8	0.0	35.0
투신	-10.2	7.4	-2.7	0.0	-22.8	60.4	0.8	0.0	0.0	-3.0
은행+보험+기타금융	-12.0	-8.7	-20.7	0.0	-8.4	-20.9	0.1	1.3	-1.2	-0.2
연기금+국가지자체	46.1	-109.9	-63.7	0.0	-1.5	-7.4	0.0	0.0	0.0	-2.8
기타법인	11.6	0.7	12.3	0.0	-0.2	-34.5	0.6	-0.1	-0.1	-1.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이

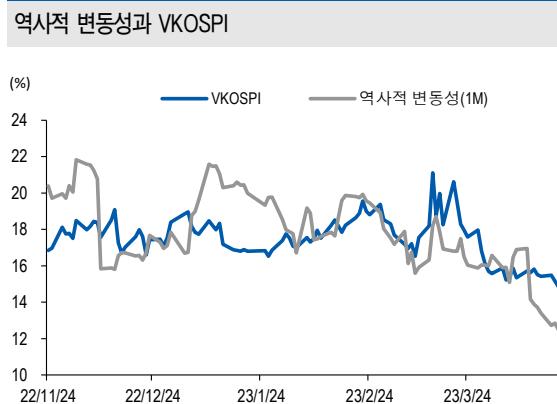


자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

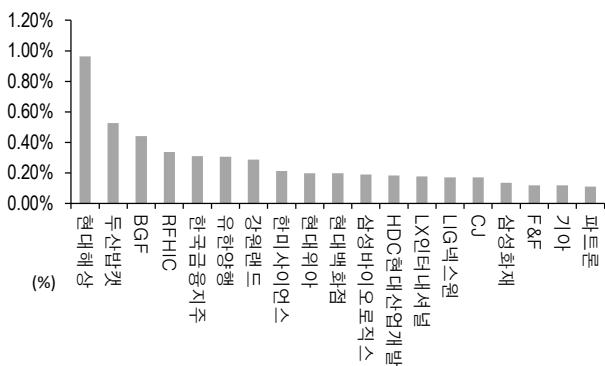
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향									(계약, 십억원)						
	거래량	거래대금	미결제약정		대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정					
Call	433,620	126.4	760,897		13.0%		지수옵션 전체	841,953	229.7	2,030,642					
Put	408,333	103.3	1,269,745		14.3%		PCR(금액기준)	0.82	VKOSPI	14.86%(-0.31%p)					
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	340.0(K+3)	2.19	-0.26	47,824	16,983	1,293	13.1	Put	335.0(K+1)	4.88	-0.20	9,842	15,458	1,597	13.8
	337.5(K+2)	3.08	-0.26	16,826	9,593	760	13.2		332.5(K+0)	3.71	-0.20	8,388	6,634	1,008	13.9
	335.0(K+1)	4.18	-0.26	11,194	17,873	696	13.2		330.0(K-1)	2.78	-0.19	21,818	13,449	901	14.1
	332.5(K+0)	5.50	-0.29	3,108	9,452	319	13.3		327.5(K-2)	2.04	-0.17	34,312	8,537	791	14.3
	330.0(K-1)	7.08	-0.28	902	13,104	65	13.5		325.0(K-3)	1.46	-0.15	37,678	14,540	67	14.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KBX 유티즌워리서치센터



자료: KBX 유파티^{증권} 리서치센터

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터