

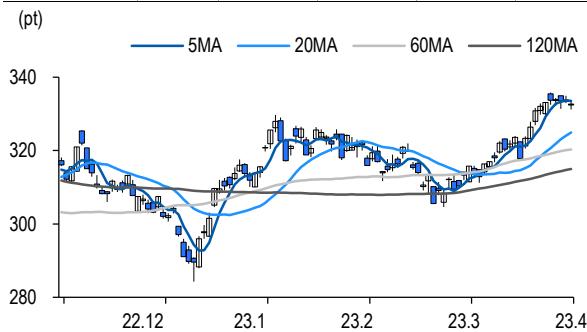


선물옵션시장 지표

2023.4.21

Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	332.66	-0.33	-1.11	7,656.3	-
선물 6월물	334.15	-0.28	-0.95	19,227.1	322,889
선물 9월물	335.45	-0.31	-1.05	28.0	22,987
5월물(mini)	333.36	-0.29	-0.96	1,687.1	47,805
6월물(mini)	334.00	-0.33	-1.00	6.4	9,459



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.55	1.30	1.49	-0.08%
베이시스(mini)	0.66	0.54	0.70	-0.04%
제1스프레드(SP)	2.01	1.55	1.55	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.66	0.62	0.62	-0.01%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

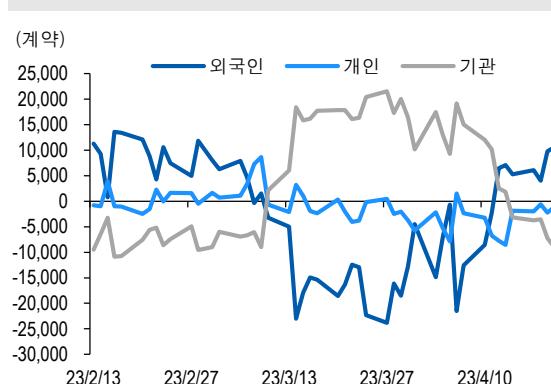
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	156.1	-19.8	136.3	0.1	197.9	57.8	10.2	-2.2	1.2	-1.7
개인	-86.0	64.6	-21.4	0.0	2.8	98.0	-3.3	0.0	-0.1	9.3
기관	-76.5	-49.7	-126.2	-21.5	-63.1	-146.6	-5.0	2.2	-1.2	-8.9
금융투자	55.7	2.7	58.5	-21.8	0.5	121.6	-3.5	2.2	-1.2	-3.2
투신	-44.2	-5.4	-49.6	0.0	-16.9	-305.6	-0.4	-0.1	0.1	-12.6
은행+보험+기타금융	17.3	-16.6	0.7	0.0	-0.1	36.1	-1.1	0.0	0.0	-1.4
연기금+국가지자체	-44.5	-30.4	-74.9	0.0	-34.7	1.3	0.0	0.0	0.0	8.2
기타법인	6.3	-0.6	5.7	0.0	-0.4	-9.3	-1.9	0.1	0.1	1.4

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	514,646	126.2	784,952	12.6%	지수옵션 전체	940,540	252.3	2,079,846							
Put	425,894	126.1	1,294,894	13.7%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	14.63%(-0.23%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	342.5(K+3)	1.10	-0.41	64,247	13,449	825	12.6	Put	337.5(K+1)	6.62	0.37	938	1,573	34	12.9
	340.0(K+2)	1.68	-0.51	59,071	18,377	1,394	12.7		335.0(K+0)	5.15	0.27	6,637	16,260	802	13.1
	337.5(K+1)	2.42	-0.66	34,377	10,909	1,316	12.7		332.5(K-1)	3.90	0.19	10,912	7,368	734	13.3
	335.0(K+0)	3.43	-0.75	17,961	19,678	1,805	12.9		330.0(K-2)	2.90	0.12	18,498	14,718	1,269	13.5
	332.5(K-1)	4.69	-0.81	7,985	10,231	779	13.1		327.5(K-3)	2.10	0.06	43,043	9,005	468	13.7

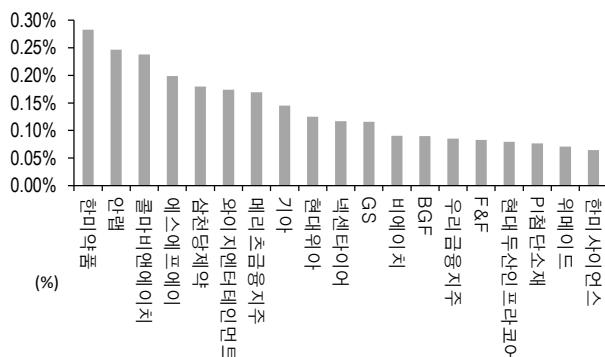
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,733,488	2,401.8	4,315,791	1,892	-1,740	-7,691	8,941	-1.7	9.3	-8.9
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	192,800	-0.82	65.5	80.4	41,356	-182	0.06%	-3,834	2,543	1,295
SK 하이닉스	87,600	-0.68	116.7	77.5	186,431	-4,460	-0.02%	7,739	3,354	-11,783
현대건설	39,500	-0.25	9.4	68.1	14,209	619	-0.05%	-425	-161	586
RFHIC	24,300	-1.62	4.6	64.4	19,705	1,461	-0.25%	277	3	-280
넥센타이어	8,560	-2.06	0.6	60.2	3,774	-68	0.12%	-1,354	138	1,216
대상	19,200	-0.52	0.6	60.2	3,719	-529	-0.09%	-489	9	480
CJ	112,800	-0.27	9.6	55.8	40,511	-1,761	-0.05%	2,261	-3,521	1,260
삼성전자	65,500	-0.15	343.6	55.7	1,104,298	-4,631	0.06%	-1,765	1,790	-131
SK 이노베이션	185,600	-1.33	48.4	55.6	13,681	-350	-0.03%	-125	-108	197
포스코퓨처엠	409,000	-1.21	275.8	52.0	26,163	367	-0.08%	850	780	-1,661

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터