

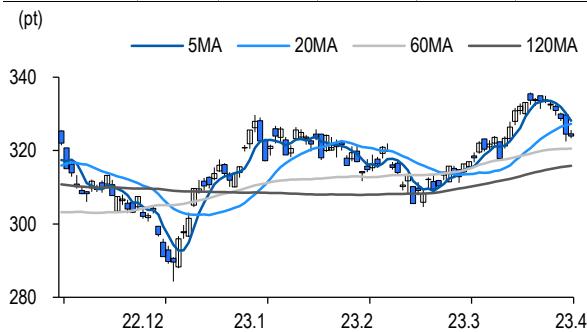


선물옵션시장 지표

2023.4.27

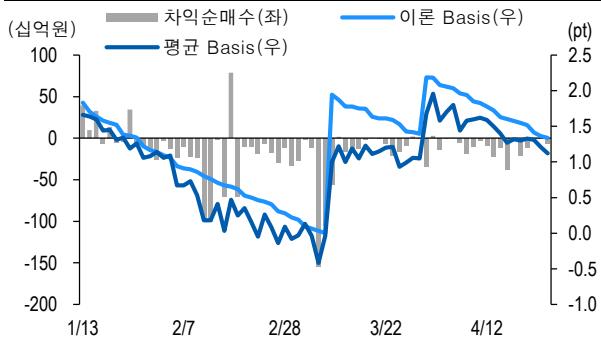
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	323.97	-0.16	-0.51	7,631.5	-
선물 6월물	325.25	-0.15	-0.50	17,556.6	322,047
선물 9월물	326.60	-0.20	-0.65	20.5	21,908
5월물(mini)	324.58	-0.18	-0.60	1,287.8	58,917
6월물(mini)	325.28	-0.15	-0.62	4.9	9,402



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.34	1.12	1.28	-0.07%
베이시스(mini)	0.47	0.43	0.61	-0.01%
제1스프레드(SP)	1.96	1.51	1.50	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.47	0.54	0.54	0.02%



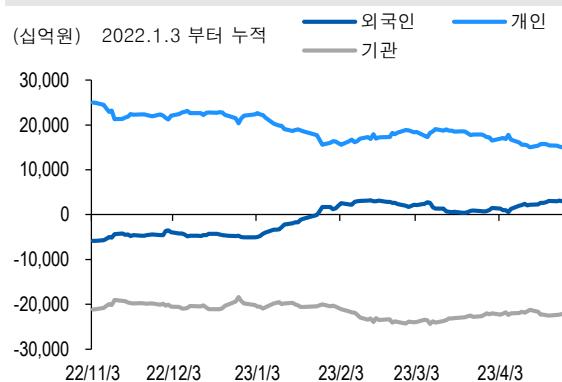
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-97.7	-22.3	-120.1	0.0	-67.4	-201.7	33.6	6.4	0.3	-8.5
개인	222.1	-355.8	-133.7	0.0	7.6	-60.7	15.4	-7.4	0.2	-36.1
기관	-148.7	327.9	179.2	-6.3	-63.9	280.2	-49.7	1.6	-0.2	47.0
금융투자	-55.7	364.7	308.9	-3.2	2.5	229.2	-49.1	1.6	-0.1	40.3
투신	-47.5	-16.3	-63.8	-3.2	-49.3	100.4	0.3	-0.3	0.0	5.0
은행+보험+기타금융	-3.8	-17.8	-21.6	0.0	-2.2	-35.1	-1.0	0.3	0.0	-0.4
연기금+국가지자체	15.3	-2.4	12.9	0.1	-1.4	-14.4	0.0	0.0	0.0	2.1
기타법인	24.3	0.7	25.0	0.0	0.3	-17.8	0.7	-0.6	-0.3	-2.4

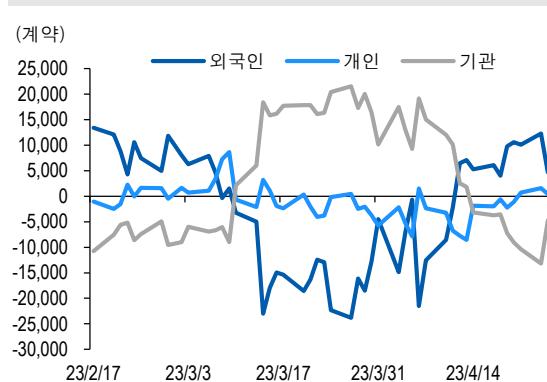
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	607,027	153.9	919,598	12.8%	지수옵션 전체	1,100,336	301.4	2,299,481
Put	493,309	147.5	1,379,883	14.1%	PCR(금액기준)	0.96	VKOSPI	15.09% (+0.07%p)
Call	332.5(K+3)	0.86	-0.21	93,964	21,741	1,370	12.8	327.5(K+1)
	330.0(K+2)	1.44	-0.31	87,807	22,538	-1,228	13.0	325.0(K+0)
	327.5(K+1)	2.28	-0.37	44,239	9,158	838	13.2	322.5(K-1)
	325.0(K+0)	3.38	-0.42	21,162	9,575	-100	13.4	320.0(K-2)
	322.5(K-1)	4.80	-0.54	13,344	6,280	-1,286	13.9	317.5(K-3)
Put	327.5(K+1)	5.28	0.28	11,530	11,341	-448	13.1	
	325.0(K+0)	3.87	0.19	18,690	14,740	-706	13.3	
	322.5(K-1)	2.82	0.17	30,940	13,378	-218	13.8	
	320.0(K-2)	1.93	0.08	65,566	19,646	679	13.9	
	317.5(K-3)	1.31	0.04	76,000	19,359	-919	14.3	

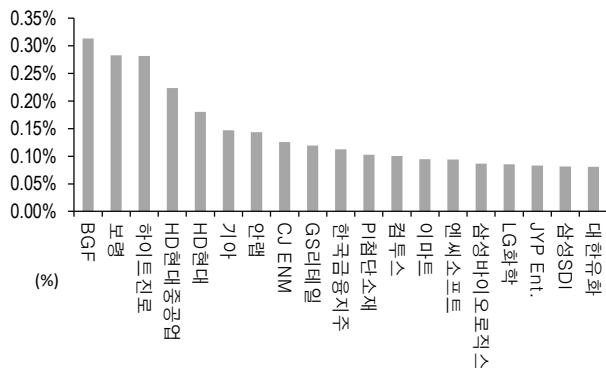
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,686,501	3,182.2	4,380,501	8,439	-64,479	-20,562	86,284	-8.5	-36.1	47.0
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
영진약품	2,950	0.51	1.8	114.3	20,475	2,434	-0.07%	-3,105	219	2,886
롯데에너지	61,300	0.33	12.0	89.8	41,328	-2,665	-0.14%	-1,526	-681	2,264
넥센타이어	8,300	-0.48	0.9	78.2	5,912	1,663	-0.76%	-4,057	10	4,047
BGF	4,145	-0.84	0.5	71.3	10,100	-285	0.31%	-1,912	-101	2,013
삼성전자	64,100	0.47	536.9	66.9	1,038,081	-31,982	0.01%	15,072	-22,662	9,355
RFHIC	23,050	-1.50	2.5	64.1	22,473	1,204	-0.51%	-950	165	785
현대건설	40,700	-0.49	13.0	63.9	17,514	-193	-0.03%	-2,087	-129	2,216
SK 하이닉스	87,500	2.58	175.4	61.8	197,457	7,079	-0.01%	-3,879	1,762	1,041
SK 이노베이션	177,100	0.85	53.2	59.6	12,165	-2,218	-0.05%	-1,784	-847	2,661
한국전력	18,510	-0.64	11.6	58.5	72,119	-80	0.00%	830	-519	-311

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터