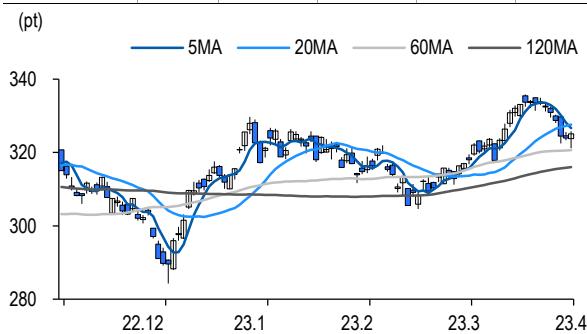


선물옵션시장 지표

2023.4.28

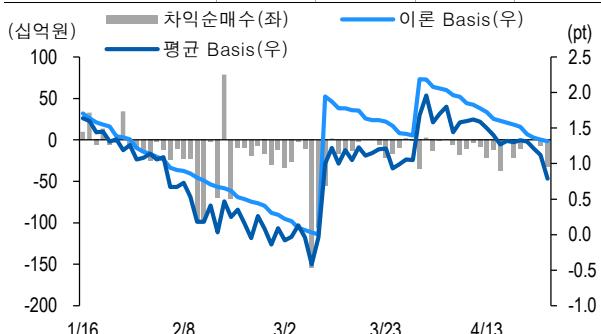
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	325.09	0.35	1.12	7,188.0	-
선물 6월물	325.85	0.18	0.60	22,416.2	315,734
선물 9월물	327.25	0.20	0.65	28.0	22,329
5월물(mini)	325.28	0.22	0.70	2,420.2	72,247
6월물(mini)	325.80	0.17	0.52	9.2	9,605



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.32	0.79	0.76	-0.16%
베이시스(mini)	0.44	0.15	0.19	-0.09%
제1스프레드(SP)	1.97	1.46	1.45	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.44	0.11	0.11	-0.10%



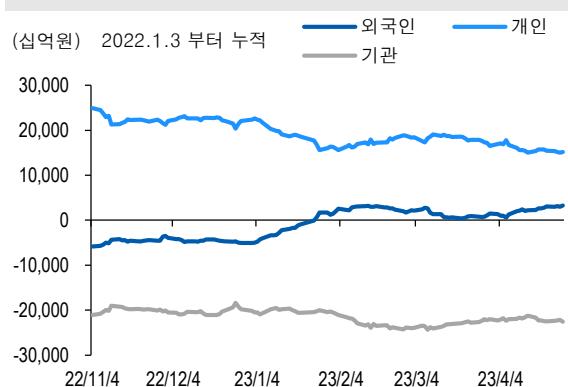
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	282.5	5.2	287.7	0.0	87.2	-465.7	172.1	-1.0	-1.9	-30.7
개인	186.6	-66.2	120.3	0.0	8.4	-134.8	-22.7	0.9	0.5	13.0
기관	-482.5	71.7	-410.7	-32.1	5.8	595.8	-150.4	0.2	1.7	18.4
금융투자	-569.1	40.4	-528.8	-32.1	-1.8	363.7	-148.3	0.5	1.7	6.4
투신	24.8	-6.1	18.7	0.0	27.1	262.7	-2.7	-0.3	0.0	9.5
은행+보험+기타금융	9.1	17.3	26.4	0.0	-8.7	-1.7	0.5	0.0	0.0	0.4
연기금+국가지자체	32.4	20.2	52.6	0.0	3.7	-28.9	0.0	0.0	0.0	2.1
기타법인	13.4	-4.8	8.6	0.0	0.1	4.7	1.0	0.0	-0.3	-0.7

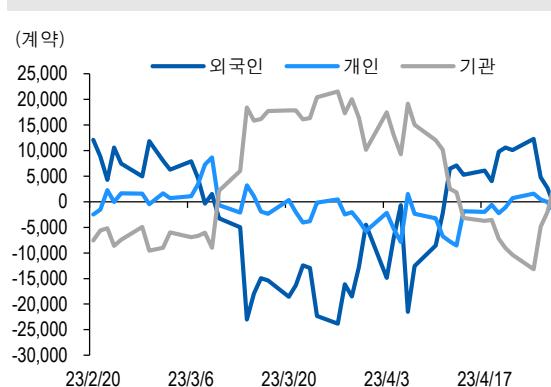
자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정		대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정					
Call	750,430	180.6	936,388		12.1%	지수옵션 전체	1,390,047	364.5		2,350,724					
Put	639,617	183.9	1,414,336		14.3%	PCR(금액기준)	1.02	VKOSPI		14.86%(-0.23%p)					
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	332.5(K+3)	0.86	0.00	127,978	22,156	415	12.0	Put	327.5(K+1)	4.61	-0.67	7,029	11,294	-47	13.5
	330.0(K+2)	1.48	0.04	155,450	25,408	2,870	12.2		325.0(K+0)	3.34	-0.53	20,501	15,434	694	13.7
	327.5(K+1)	2.36	0.08	82,978	12,235	3,077	12.3		322.5(K-1)	2.31	-0.51	29,072	13,974	596	13.9
	325.0(K+0)	3.54	0.16	52,081	12,919	3,344	12.4		320.0(K-2)	1.55	-0.38	67,901	21,530	1,884	14.1
	322.5(K-1)	5.04	0.24	13,275	8,221	1,941	12.6		317.5(K-3)	1.01	-0.30	88,711	20,862	1,503	14.4

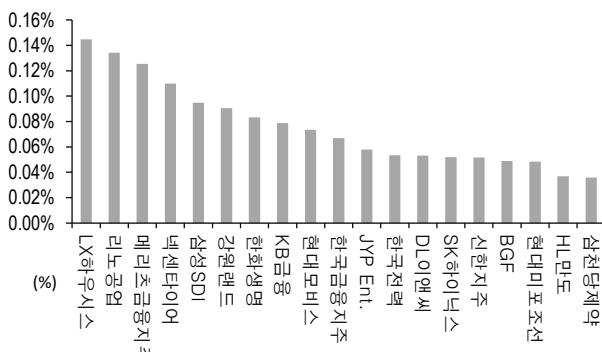
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주실선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 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	3,999,620	3,354.4	4,464,436	83,935	-8,552	29,524	-23,505	-30.7	13.0	18.4		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
롯데에너지	61,700	0.65	13.2	92.7	41,170	-158	-0.07%	218	6	-224	313	-537
영진악품	3,025	2.54	1.4	92.2	20,131	-344	-0.07%	2,449	299	-2,748	-2,748	0
삼성전자	64,700	0.94	727.8	77.1	1,073,913	35,832	-0.01%	-1,579	4,502	-4,094	-10,521	600
한세실업	17,300	2.37	4.0	72.6	48,729	9,063	-3.84%	8,355	226	-8,581	-8,148	0
SK 하이닉스	89,100	1.83	178.4	69.1	211,780	14,323	0.05%	-8,015	6,543	687	-8,652	-2,843
현대차	202,000	-0.25	133.8	67.9	52,647	287	-0.08%	-1,362	886	486	959	138
RFHIC	23,200	0.65	3.0	64.4	23,448	975	-0.55%	-1,970	4	1,966	3,157	0
SK 이노베이션	178,300	0.68	57.1	62.9	12,918	753	-0.04%	-809	204	602	935	-173
BGF	4,115	-0.72	0.2	62.4	10,496	396	0.05%	-353	148	205	201	0
LG 화학	742,000	1.78	141.7	61.1	9,339	1,710	0.01%	-1,466	326	1,135	381	705

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터