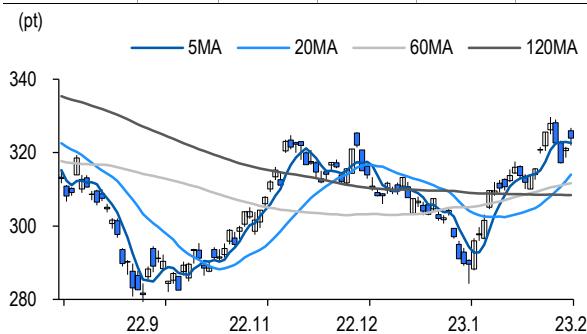


선물옵션시장 지표

2023.2.3

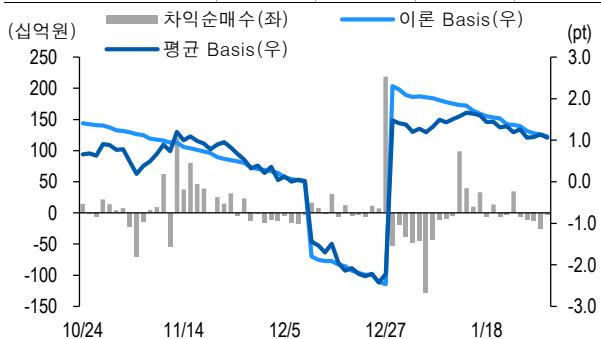
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
	326.23	0.46	1.49	4,688.4	-
3월물(big)	323.25	-0.48	-1.55	13,735.7	236,900
6월물(big)	324.05	-0.90	-2.95	11.0	17,908
1월물(mini)	322.54	-0.41	-1.32	956.6	29,902
2월물(mini)	324.26	0.00	0.00	0.0	4



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.09	1.06	1.17	-0.01%
베이시스(mini)	0.22	0.29	0.27	0.02%
제1스프레드(SP)	2.10	1.91	1.90	-0.06%
합성선물 베이시스(ATM)	0.22	0.26	0.26	0.01%



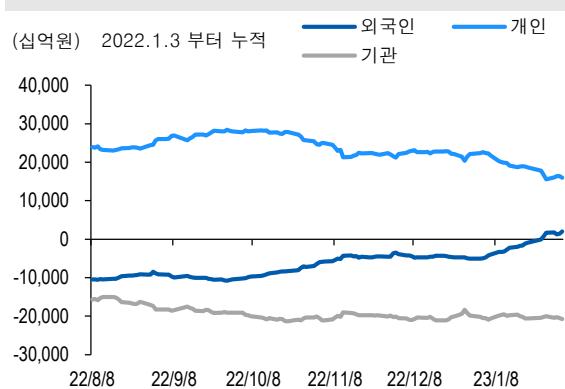
투자주체별 매매 동향

(십억원)

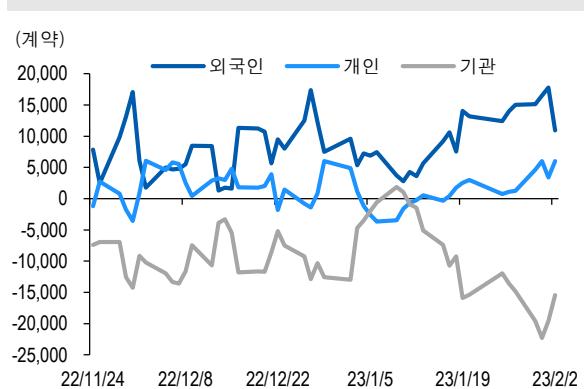
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	554.8	-30.9	523.9	0.4	293.6	-487.3	-69.7	5.6	-0.1	-17.0
개인	-356.1	-26.6	-382.7	0.0	-0.2	186.2	26.9	0.0	-3.8	1.4
기관	-276.2	33.7	-242.5	-3.0	-81.8	292.1	42.2	-5.7	4.2	18.4
금융투자	-157.4	46.7	-110.7	-2.9	-4.5	121.9	43.8	-5.7	3.5	-0.7
투신	-18.4	27.0	8.6	0.0	-23.1	58.6	-1.5	0.0	0.0	24.8
은행+보험+기타금융	16.9	-43.8	-26.9	0.0	4.9	84.7	-0.1	0.0	0.7	0.1
연기금+국가지자체	-75.9	-12.3	-88.1	0.0	-29.6	27.0	0.0	0.0	0.0	-5.8
기타법인	77.4	24.3	101.8	0.0	0.1	9.0	0.7	0.1	-0.3	-2.8

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	1,265,713	350.0	988,430	16.4%	지수옵션 전체	2,418,315	598.8	2,474,882
Put	1,152,602	248.8	1,406,452	17.4%	PCR(금액기준)	0.71	VKOSPI	17.08%(-0.46%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	327.5(K+3)	1.75	0.35	153,506	21,996	-203	16.3	Put
	325.0(K+2)	2.72	0.54	83,162	23,081	-1,464	16.2	
	322.5(K+1)	4.06	0.81	31,212	16,486	-89	16.5	
	320.0(K+0)	5.72	1.10	17,050	24,456	169	16.9	
	317.5(K-1)	7.65	1.37	9,191	13,195	-875	17.3	

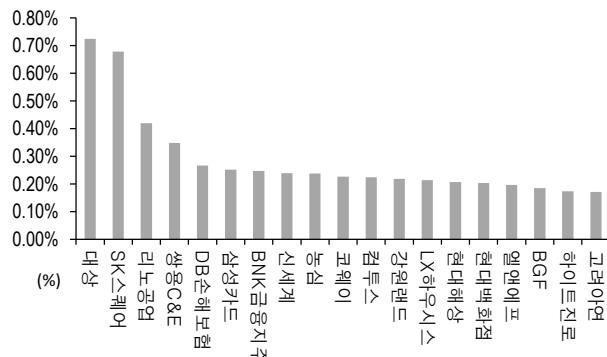
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,999,003	2,740.7	4,581,261	-7,081	-57,631	7,848	50,928	-17.0	1.4	18.4
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	6,950	1.02	1.2	112.9	2,763	-376	-0.09%	-1,950	78	1,872
일진미티리얼즈	66,100	3.12	12.3	71.7	41,422	3,397	0.14%	1,582	1,812	-3,384
현대제철	34,200	-2.43	9.0	66.4	21,249	-40	-0.01%	-2,845	962	1,883
메리츠증권	6,570	-1.20	7.5	62.6	68,322	5,408	-0.17%	643	-990	287
SK 하이닉스	93,500	2.63	233.6	57.3	159,356	-6,216	-0.07%	-13,646	-9,160	22,796
현대차	170,600	0.24	52.5	56.2	35,350	-1,043	0.03%	-996	-713	1,718
포스코케미칼	224,500	0.00	103.8	51.9	37,468	-2,588	0.05%	-914	483	434
삼성SDI	720,000	-0.41	86.7	51.5	16,695	-1,231	0.00%	-170	-130	322
카카오	64,600	3.53	96.8	51.3	75,970	9,932	0.02%	4,601	4,379	-9,115
삼성전자	63,500	2.58	735.0	50.2	1,178,373	-27,489	0.06%	-1,188	-20,565	21,297

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터