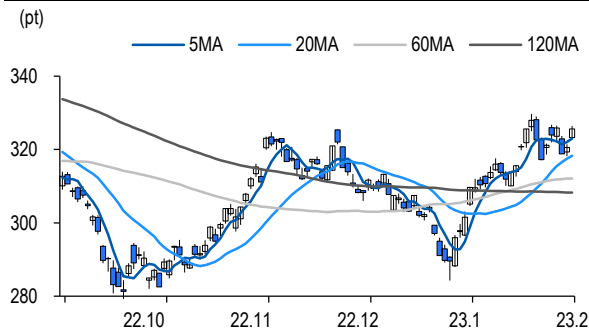


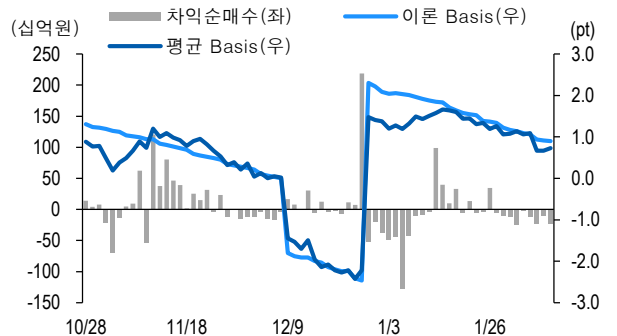
선물옵션시장 지표

2023.2.9

| Market Data | | (십억원, 계약) | | | | |
|-------------|--------|-----------|---------|----------|---------|--|
| | 증가(pt) | 등락률(%) | 등락폭(pt) | 거래대금 | 미결제 | |
| KOSPI200 | 325.63 | 1.58 | 5.08 | 6,088.6 | - | |
| 선물 3월물 | 326.35 | 1.57 | 5.05 | 16,838.6 | 297,392 | |
| 선물 6월물 | 328.30 | 1.59 | 5.15 | 25.1 | 36,482 | |
| 2월물(mini) | 325.50 | 1.50 | 4.82 | 1,338.9 | 88,522 | |
| 3월물(mini) | 326.22 | 1.53 | 4.80 | 71.4 | 6,533 | |

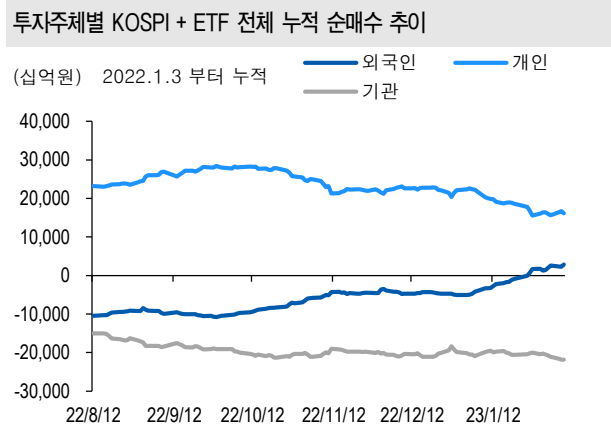


| 차익거래 관련 Market data | | (pt) | | | |
|---------------------|------|-------|-------|--------|--|
| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) | |
| K200 베이스스 | 0.90 | 0.73 | 0.72 | -0.05% | |
| 베이스스(mini) | 0.03 | -0.01 | -0.13 | -0.01% | |
| 제1스프레드(SP) | 1.99 | 1.92 | 1.95 | -0.02% | |
| 합성선물 베이스스(ATM) | 0.03 | -0.08 | -0.08 | -0.03% | |

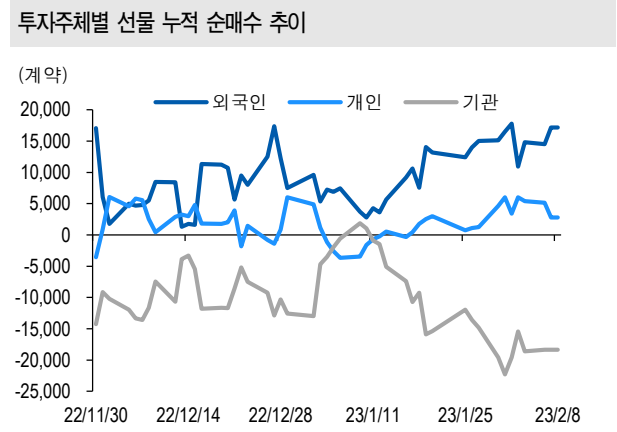


| 투자주체별 매매 동향 | | (십억원) | | | | | | | | | |
|-------------|--------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|--|
| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 | |
| 외국인 | 579.3 | 6.3 | 585.6 | 0.2 | 270.2 | 69.8 | -86.1 | 4.2 | 0.1 | 21.7 | |
| 개인 | -563.3 | 26.2 | -537.1 | 0.0 | 4.2 | -72.8 | -0.2 | 0.2 | -1.2 | -20.4 | |
| 기관 | 3.6 | -41.8 | -38.2 | -22.8 | -30.6 | 14.3 | 86.3 | -2.9 | 2.2 | -2.1 | |
| 금융투자 | -54.8 | -55.5 | -110.3 | -17.9 | -1.8 | -177.8 | 80.1 | -3.7 | 1.9 | 1.1 | |
| 투신 | 30.1 | 10.7 | 40.8 | 0.0 | -8.8 | 207.4 | 2.7 | 0.2 | 0.0 | 15.8 | |
| 은행+보험+기타금융 | 8.9 | 6.8 | 15.7 | 0.0 | -10.1 | 0.2 | 3.5 | 0.4 | 0.4 | -9.2 | |
| 연기금+국가자재 | -26.3 | -9.5 | -35.8 | 0.0 | -3.2 | -15.6 | 0.0 | 0.1 | -0.1 | -9.8 | |
| 기타법인 | -19.5 | 13.6 | -6.0 | 0.0 | 0.7 | -11.3 | 0.1 | -1.5 | -1.1 | 0.8 | |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



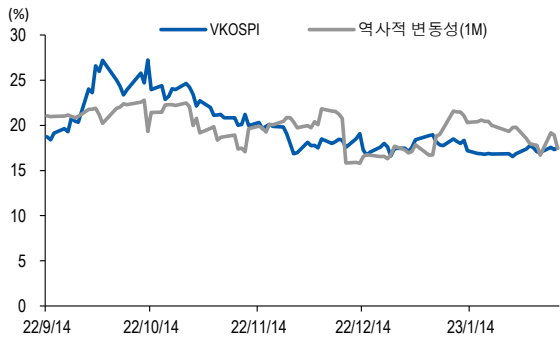
선물옵션시장 지표

| 지수옵션 시장동향 | | | | | (계약, 십억원) | | | |
|-----------|-----------|-------|-----------|-------|-----------|-----------|--------|-----------------|
| | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | 대표변동성 | | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 |
| Call | 1,725,029 | 410.3 | 1,139,897 | 13.4% | 지수옵션 전체 | 3,200,285 | 634.7 | 2,860,510 |
| Put | 1,475,256 | 224.4 | 1,720,613 | 18.3% | PCR(금액기준) | 0.55 | VKOSPI | 17.50%(+0.19%p) |

| | 행사가 | 증가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | | 행사가 | 증가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 |
|------|------------|------|--------|---------|--------|---------|-------|-----|------------|------|--------|---------|--------|--------|-------|
| Call | 327.5(K+3) | 0.61 | 0.37 | 389,519 | 32,841 | -3,475 | 13.7 | Put | 322.5(K+1) | 0.45 | -2.64 | 255,670 | 24,766 | 8,776 | 16.2 |
| | 325.0(K+2) | 1.65 | 1.06 | 312,207 | 28,648 | -11,093 | 13.3 | | 320.0(K+0) | 0.15 | -1.61 | 313,058 | 39,087 | 13,555 | 17.0 |
| | 322.5(K+1) | 3.42 | 2.15 | 130,430 | 21,915 | -5,269 | 12.7 | | 317.5(K-1) | 0.06 | -0.84 | 241,906 | 41,165 | 12,706 | 18.8 |
| | 320.0(K+0) | 5.70 | 3.26 | 37,927 | 24,686 | -1,744 | 10.4 | | 315.0(K-2) | 0.03 | -0.40 | 127,291 | 42,191 | 9,693 | 21.2 |
| | 317.5(K-1) | 8.06 | 4.01 | 12,551 | 13,913 | -834 | 5.6 | | 312.5(K-3) | 0.02 | -0.18 | 67,260 | 27,104 | -1,995 | 24.1 |

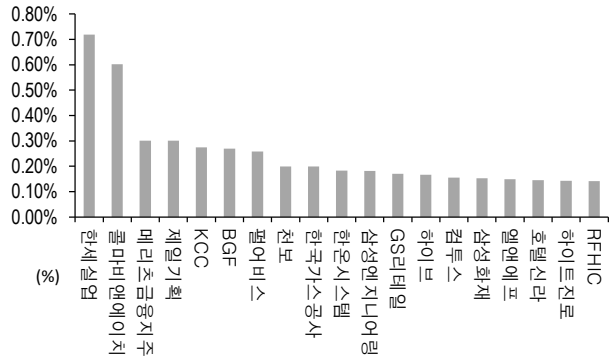
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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 | 3,634,576 | 2,655.7 | 4,486,678 | -73,704 | 27,153 | -47,939 | 19,809 | 21.7 | -20.4 | -2.1 |

| 종목명 | 선물현재가 (원) | 등락률 (%) | 선물거래대금 (십억원) | 선현배율 (%) | 미결제수량 (계약) | 미결제증감 (계약) | 평균괴리율 (%) | 외국인 순매수 | 개인 순매수 | 기관 순매수 | 금융투자 순매수 | 연기금등 순매수 |
|---------|-----------|---------|--------------|----------|------------|------------|-----------|---------|--------|--------|----------|----------|
| 일진머티리얼즈 | 64,100 | -2.88 | 10.3 | 53.8 | 18,578 | -18,254 | -0.01% | -2,910 | 1,568 | 1,282 | 526 | 741 |
| SK 하이닉스 | 95,000 | 4.63 | 182.6 | 51.5 | 88,165 | -19,111 | 0.02% | 8,173 | -7,624 | -368 | -5,485 | -190 |
| 삼성전자 | 63,100 | 1.77 | 390.9 | 50.9 | 470,133 | -322,729 | -0.05% | 11,215 | -8,522 | -2,945 | 5,424 | 2,765 |
| 롯데케미칼 | 172,900 | -1.71 | 13.3 | 48.2 | 22,113 | -1,872 | -0.08% | 1,569 | -801 | -748 | -572 | 44 |
| 현대차 | 172,700 | 1.35 | 35.1 | 46.1 | 15,481 | -9,943 | 0.01% | 1,732 | -1,223 | -512 | -478 | -32 |
| 호텔신라 | 81,400 | 1.24 | 9.1 | 43.8 | 17,017 | -3,691 | 0.15% | 1,372 | -978 | -394 | -2,155 | -271 |
| 삼성 SDI | 729,000 | 2.68 | 81.5 | 42.3 | 9,088 | -3,820 | 0.02% | -296 | 316 | -29 | 177 | -145 |
| 하나금융지주 | 48,800 | 1.46 | 22.5 | 42.1 | 64,350 | -4,055 | 0.04% | 2,371 | -787 | -1,574 | -1,409 | -161 |
| RFHIC | 24,800 | 0.61 | 1.5 | 41.4 | 6,405 | -4,969 | 0.14% | -1,577 | 549 | 1,024 | -1,499 | 0 |
| 카카오 | 69,000 | 1.32 | 87.2 | 40.7 | 47,500 | -7,208 | -0.10% | -8,073 | -332 | 8,375 | 5,738 | 1,135 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터