

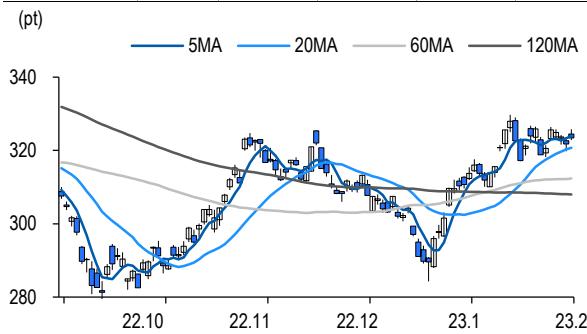


선물옵션시장 지표

2023.2.15

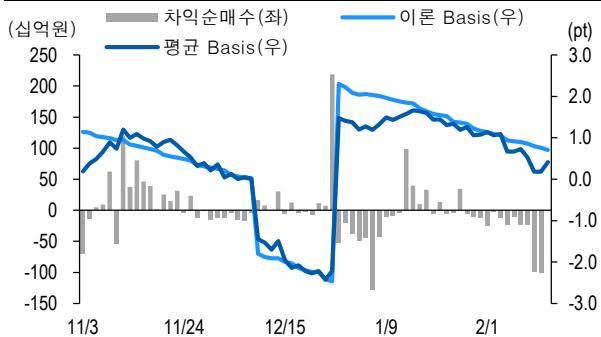
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	323.47	0.53	1.72	5,258.8	-
선물 3월물	324.85	0.70	2.25	18,123.2	303,009
선물 6월물	326.75	0.83	2.70	83.9	37,936
3월물(mini)	324.64	0.63	2.00	1,280.0	28,198
4월물(mini)	325.10	0.81	2.62	84.3	7,064



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.71	0.41	1.38	-0.09%
베이시스(mini)	0.71	0.41	1.17	-0.09%
제1스프레드(SP)	1.99	1.90	1.90	-0.03%
합성선물 베이시스(ATM)	0.71	1.32	1.32	0.19%



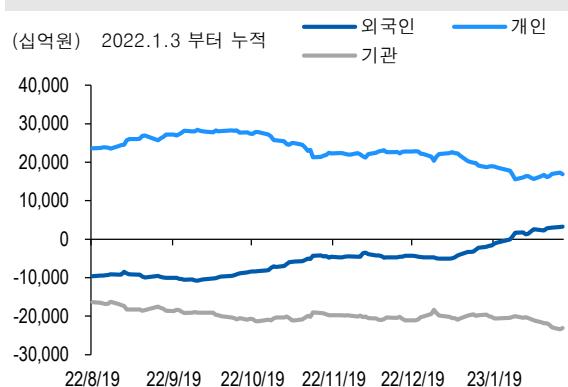
투자주체별 매매 동향

(십억원)

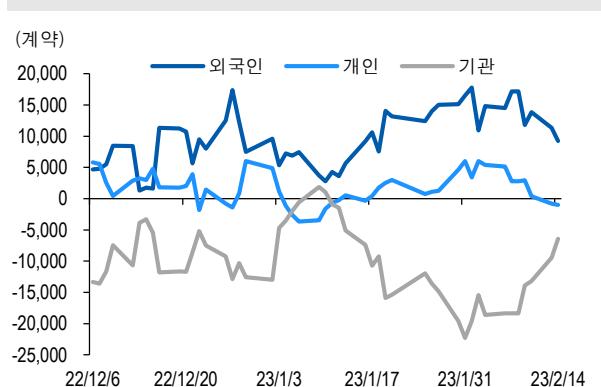
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	61.2	30.6	91.8	-2.0	98.4	-103.5	-62.5	-8.4	-4.6	4.0
개인	-385.5	-1.5	-387.0	0.0	-1.7	-15.0	-1.4	5.4	0.8	-18.1
기관	301.8	-20.3	281.5	0.4	-39.5	180.0	64.4	2.2	3.6	13.9
금융투자	270.7	-120.2	150.5	-1.3	-1.8	-113.7	64.1	2.1	3.5	11.0
투신	11.5	52.7	64.2	0.0	-10.1	303.4	0.1	0.0	0.0	4.3
은행+보험+기타금융	-2.7	71.5	68.8	0.0	-11.7	-9.0	0.1	0.0	0.1	-0.1
연기금+국가지자체	42.1	-27.9	14.2	1.7	0.2	-0.7	0.0	0.0	0.0	-1.4
기타법인	22.5	-9.0	13.5	0.0	-0.4	-61.6	-0.5	0.8	0.2	0.2

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	527,660	218.7	709,842	17.5%	지수옵션 전체	1,006,253	388.0	1,806,975							
Put	478,593	169.3	1,097,133	17.4%	PCR(금액기준)	0.77	VKOSPI	18.52% (+0.29%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	330.0(K+3)	3.43	0.80	32,419	21,194	167	17.6	Put	325.0(K+1)	5.74	-1.16	7,643	7,890	884	16.1
	327.5(K+2)	4.36	0.87	16,665	11,442	3,617	17.6		322.5(K+0)	4.61	-1.00	9,866	4,948	548	16.4
	325.0(K+1)	5.51	1.01	10,986	15,775	665	17.8		320.0(K-1)	3.72	-0.79	23,346	12,341	2,174	16.9
	322.5(K+0)	6.90	1.17	6,352	4,359	267	18.2		317.5(K-2)	2.93	-0.64	23,825	9,752	2,510	17.3
	320.0(K-1)	8.48	1.36	3,309	11,544	-1,194	18.7		315.0(K-3)	2.23	-0.57	41,411	19,895	3,700	17.4

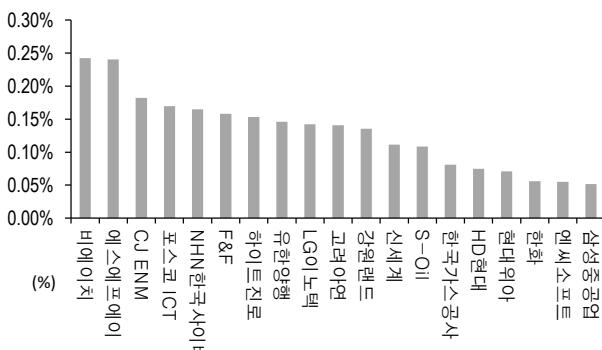
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,517,391	1,882.0	3,838,747	92,620	-13,734	-11,230	25,026	4.0	-18.1	13.9
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
후성	12,310	-0.24	4.5	75.5	13,047	6,823	-0.47%	982	185	-1,167
일진머티리얼즈	64,200	0.94	8.5	70.3	43,015	-334	-0.01%	2,176	-1,763	-403
LG 이노텍	282,000	1.44	26.2	63.4	22,630	888	0.14%	1,006	272	-1,282
넥센타이어	7,260	-0.95	1.2	58.8	8,894	1,428	-0.58%	-1,923	3,039	-1,116
삼성전자	63,400	0.79	340.3	58.7	1,063,767	10,204	-0.07%	-10,007	5,899	4,815
아모레퍼시픽	152,600	2.14	12.8	56.5	10,820	478	-0.04%	992	-187	-808
SK	198,000	0.66	11.1	56.2	3,421	29	-0.20%	-104	22	82
포스코케미칼	229,000	0.00	96.2	55.8	39,390	917	-0.09%	1,038	-296	-953
현대차	174,300	0.93	47.0	53.7	31,669	-159	-0.01%	-1,416	939	436
LG 화학	678,000	1.04	57.4	53.2	5,948	-37	-0.07%	-236	-132	319

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터