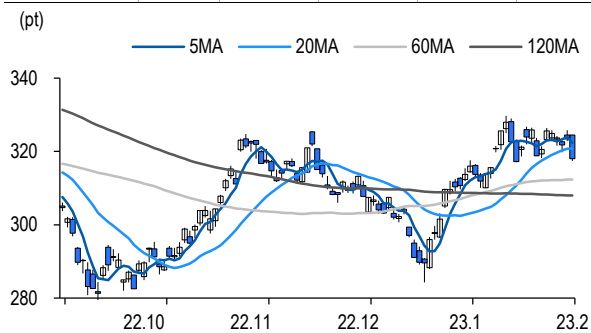


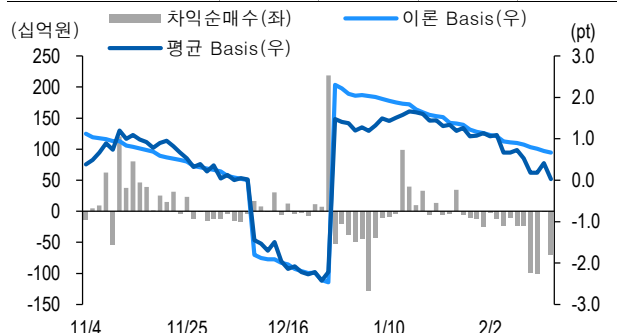
선물옵션시장 지표

2023.2.16

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	317.99	-1.69	-5.48	6,902.9	-
선물 3월물	317.40	-2.29	-7.45	19,295.9	311,561
선물 6월물	319.45	-2.23	-7.30	47.8	38,615
3월물(mini)	317.38	-2.30	-7.26	1,196.3	34,436
4월물(mini)	318.00	-2.18	-7.10	4.0	14,538



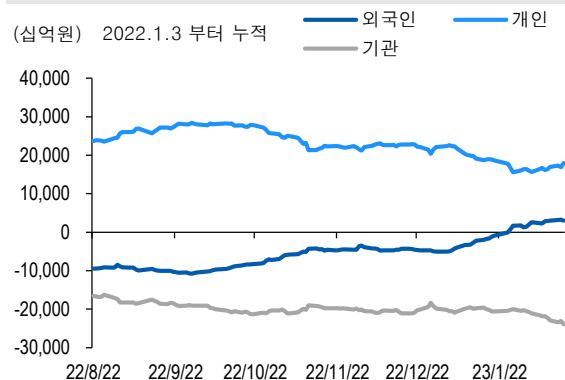
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.67	0.03	-0.59	-0.20%
베이스(mini)	0.67	0.03	-0.61	-0.20%
제1스프레드(SP)	1.94	1.90	1.85	-0.01%
합성선물 베이스(ATM)	0.67	-0.51	-0.51	-0.37%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-266.0	-6.1	-272.2	-26.2	-135.6	-584.0	-99.6	-3.3	-2.0	-23.8
개인	1,017.0	29.5	1,046.5	0.0	1.5	342.4	53.2	-0.6	-1.5	-1.2
기관	-778.6	-45.3	-823.9	-43.8	-28.4	213.9	47.3	3.4	3.0	28.5
금융투자	-552.5	-28.7	-581.2	-39.0	2.2	608.7	47.6	4.7	3.2	44.3
투신	-61.3	-0.4	-61.7	0.0	-26.1	-517.2	-0.1	-0.7	0.1	-20.0
은행+보험+기타금융	-2.4	-43.7	-46.1	0.0	0.2	87.7	-0.2	-0.6	-0.3	0.0
연기금+국가지자체	-55.4	8.3	-47.1	-1.6	5.8	34.7	0.0	0.0	0.0	4.1
기타법인	27.7	6.1	33.8	0.0	0.3	27.7	-0.8	0.4	0.5	-3.5

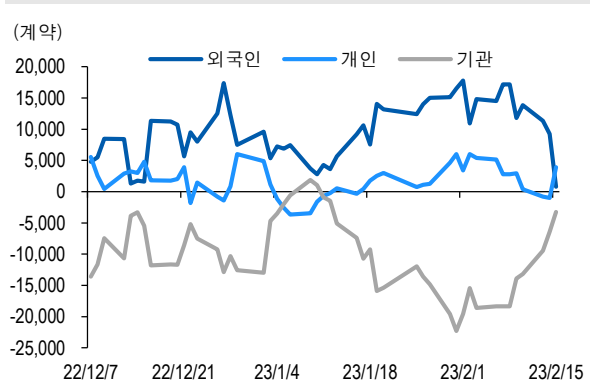
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



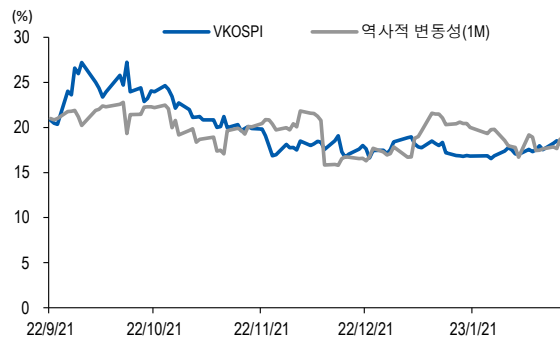
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	675,724	178.9	773,749	15.0%	지수옵션 전체	1,209,819	401.9	1,911,947
Put	534,095	222.9	1,138,198	18.4%	PCR(금액기준)	1.25	VKOSPI	18.18%(-0.34%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	1.20	-2.23	59,213	24,573	3,379	15.2	Put	325.0(K+1)	9.86	4.12	3,035	7,935	45	19.3
	327.5(K+2)	1.69	-2.67	42,322	14,040	2,598	15.1		322.5(K+0)	8.08	3.47	7,005	5,329	381	18.7
	325.0(K+1)	2.29	-3.22	27,492	18,372	2,597	14.9		320.0(K-1)	6.62	2.90	15,380	13,694	1,353	18.6
	322.5(K+0)	3.06	-3.84	12,728	5,641	1,282	14.7		317.5(K-2)	5.23	2.30	23,714	11,001	1,249	18.3
	320.0(K-1)	4.04	-4.44	9,166	13,072	1,528	14.6		315.0(K-3)	4.12	1.89	47,128	21,804	1,909	18.2

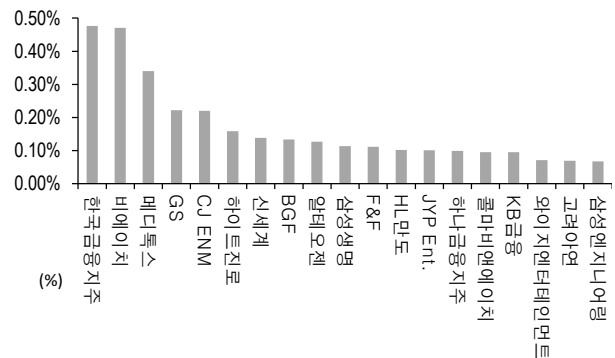
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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	3,811,558	2,785.8	4,057,331	218,584	-47,737	-1,159	50,235	-23.8	-1.2	28.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
메리츠증권	6,610	-1.34	6.7	90.1	72,220	9,916	-0.18%	15,260	-2,120	-13,140	-13,226	0
삼성전자	62,300	-1.74	648.2	78.8	1,100,407	36,640	-0.02%	5,268	3,886	-10,326	-4,766	-3,320
SK 하이닉스	91,700	-1.61	127.9	77.6	126,492	-21	-0.08%	-4,405	3,613	823	5,195	-563
넥센타이어	7,180	-1.10	0.8	73.3	7,067	-1,827	0.00%	2,880	-751	-2,129	-2,129	0
삼성 SDI	722,000	-2.30	128.1	64.6	13,883	154	-0.11%	200	397	-603	-383	-55
RFHIC	23,700	-4.44	2.4	64.5	12,405	1,195	0.00%	923	-81	-842	-682	0
현대차	172,700	-0.92	48.3	61.8	31,008	-661	-0.01%	539	-1,316	878	524	134
LG 이노텍	276,000	-2.13	27.4	60.0	22,027	-603	0.05%	-1,408	-178	1,591	560	1,102
롯데케미칼	173,600	-1.75	10.1	58.5	12,928	-446	0.04%	404	693	-1,097	-970	-125
일진머티리얼즈	62,300	-2.96	11.0	58.1	44,130	1,115	0.03%	73	539	-619	-517	-102

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터