

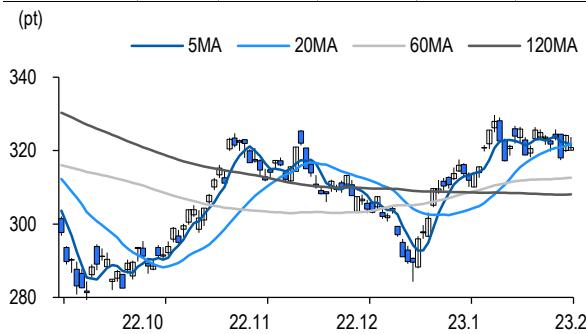


선물옵션시장 지표

2023.2.20

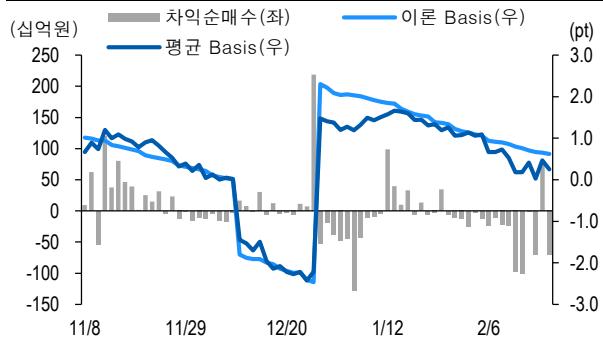
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	320.78	-1.02	-3.32	5,743.0	-
선물 3월물	321.55	-0.79	-2.55	18,976.1	309,148
선물 6월물	323.20	-0.83	-2.70	69.0	39,287
3월물(mini)	321.50	-0.80	-2.60	1,257.1	37,432
4월물(mini)	321.54	-0.86	-2.78	5.3	14,760



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.62	0.25	0.77	-0.11%
베이시스(mini)	0.62	0.26	0.72	-0.11%
제1스프레드(SP)	1.98	1.80	1.75	-0.06%
합성선물 베이시스(ATM)	0.62	0.75	0.75	0.04%



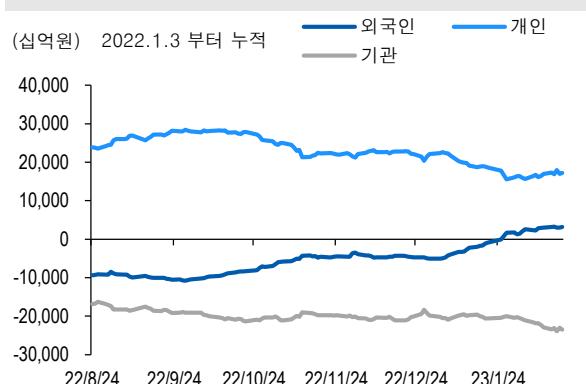
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	120.4	39.0	159.4	0.1	171.3	81.2	-95.3	8.6	-6.4	-10.0
개인	224.0	21.5	245.5	0.0	1.7	-31.7	24.6	-9.6	1.3	21.5
기관	-384.0	-83.5	-467.5	-71.1	-22.1	-56.7	68.0	1.0	5.2	-9.8
금융투자	-384.8	-127.5	-512.3	-69.7	-2.5	404.7	68.4	1.0	5.0	4.3
투신	-15.8	18.7	2.9	0.0	-10.2	-451.4	-0.3	0.0	0.2	-15.3
은행+보험+기타금융	22.1	18.9	40.9	0.0	-0.1	-10.6	0.0	0.1	0.0	0.1
연기금+국가지자체	0.4	0.3	0.7	0.0	0.6	0.7	0.0	0.0	0.0	1.0
기타법인	39.6	14.3	53.9	0.0	-0.1	7.2	2.7	0.0	-0.1	-1.7

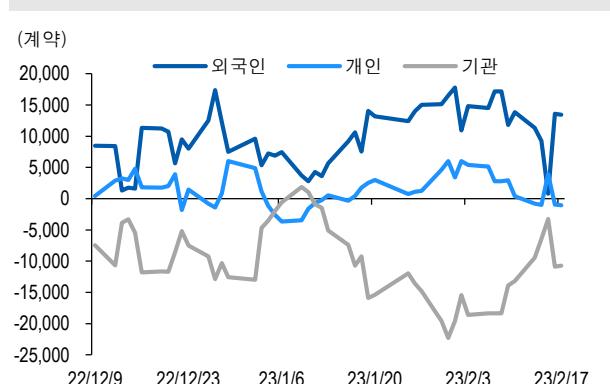
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	560,097	187.2	803,840	16.0%	지수옵션 전체	1,128,081	395.6	2,021,516							
Put	567,984	208.4	1,217,676	16.7%	PCR(금액기준)	1.11	VKOSPI	18.23% (+0.39%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	332.5(K+3)	1.32	-0.65	54,238	19,007	1,145	16.1	Put	327.5(K+1)	8.51	1.53	511	4,116	-15	15.8
	330.0(K+2)	1.83	-0.80	58,981	24,587	1,506	16.0		325.0(K+0)	6.93	1.34	5,148	9,511	451	16.0
	327.5(K+1)	2.53	-1.04	41,827	16,262	1,209	16.1		322.5(K-1)	5.53	1.13	8,170	6,403	978	16.2
	325.0(K+0)	3.46	-1.15	23,231	21,316	86	16.3		320.0(K-2)	4.36	0.93	21,497	15,260	1,317	16.5
	322.5(K-1)	4.55	-1.41	8,452	7,810	2,091	16.5		317.5(K-3)	3.37	0.74	32,942	12,808	829	16.7

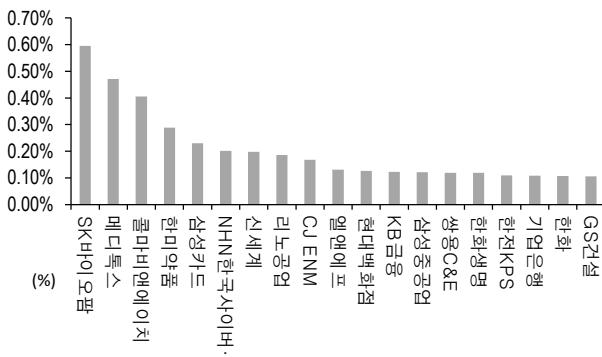
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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	3,163,926	2,374.6	4,207,077	99,940	43,434	35,109	-78,217	-10.0	21.5	-9.8
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	7,310	-0.95	1.7	238.8	8,708	2,105	-0.33%	-3,431	-963	4,394
메리츠증권	6,600	0.30	6.8	191.3	59,416	-1,048	-0.21%	5,319	-2,417	-5,083
SK 하이닉스	92,500	-0.64	134.5	91.8	128,878	2,439	-0.02%	-2,376	-6,808	9,755
삼성전자	63,000	-1.10	529.8	78.9	1,120,764	16,517	0.00%	7,424	-4,123	-3,221
영원무역	44,900	0.11	1.8	68.3	1,916	383	-0.34%	-721	95	626
현대차	179,200	-0.28	54.9	67.3	32,996	-837	-0.01%	-1,640	601	1,034
LG 이노텍	289,500	-0.52	27.1	67.1	22,183	-1,436	0.02%	-1,676	397	1,278
서울반도체	11,010	-0.45	1.2	64.5	3,483	-63	-0.06%	-273	530	-257
삼성 SDI	705,000	-4.08	101.8	59.6	13,215	-563	-0.05%	-347	-503	869
LG 화학	693,000	-3.62	106.2	59.0	7,573	3	0.01%	-991	-11	1,066

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터