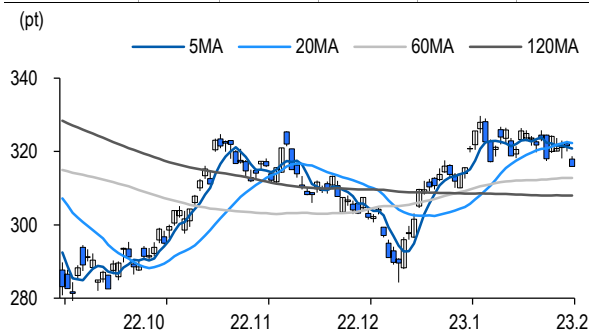


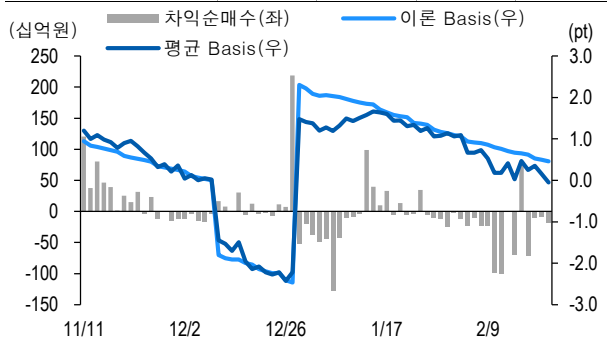
선물옵션시장 지표

2023.2.23

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	315.94	-1.75	-5.62	5,782.4	-
선물 3월물	316.20	-1.80	-5.80	18,660.5	313,839
선물 6월물	317.95	-1.82	-5.90	74.5	40,892
3월물(mini)	316.16	-1.81	-5.84	1,283.2	41,836
4월물(mini)	316.30	-1.77	-5.70	9.4	15,222



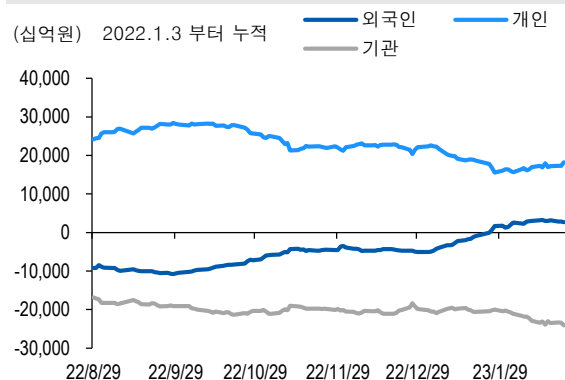
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.46	-0.05	0.26	-0.16%
베이스(mini)	0.46	-0.05	0.22	-0.16%
제1스프레드(SP)	1.96	1.79	1.80	-0.05%
합성선물 베이스(ATM)	0.46	0.30	0.30	-0.05%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-240.5	18.6	-221.9	0.0	-187.5	-364.7	1.6	-3.2	-0.5	-8.5
개인	887.0	-5.8	881.2	0.0	-3.3	277.3	24.5	0.4	-2.1	37.3
기관	-687.5	1.0	-686.6	-18.8	-31.7	58.9	-25.1	2.7	2.4	-27.2
금융투자	-507.0	4.6	-502.4	-10.9	-20.5	235.2	-24.8	3.0	2.0	-14.4
투신	-38.6	-17.1	-55.6	0.0	-9.6	-272.6	-0.4	-0.3	0.1	-12.8
은행+보험+기타금융	15.7	-2.9	12.8	0.0	5.6	90.7	0.1	-0.1	0.3	-0.7
연기금+국가지자체	-43.1	2.3	-40.8	0.0	1.6	5.6	0.0	0.0	0.0	0.6
기타법인	41.1	-13.9	27.2	0.0	0.0	28.5	-1.0	0.2	0.2	-1.5

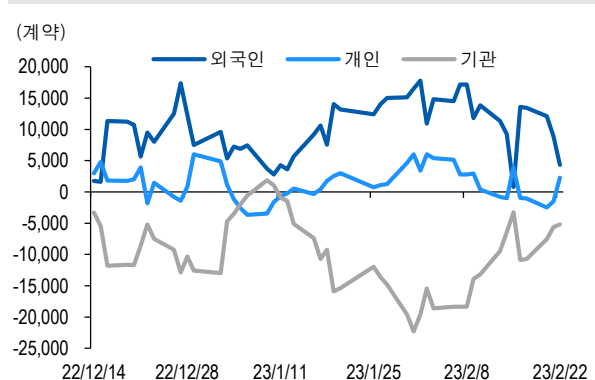
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



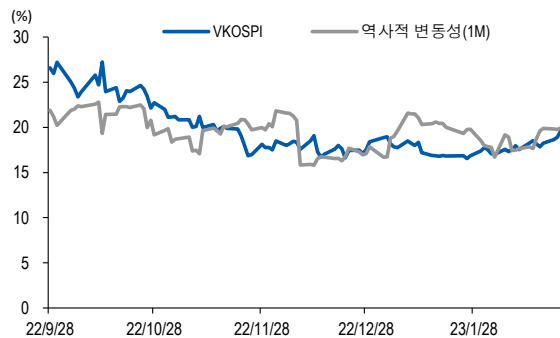
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	623,578	164.2	871,459	17.2%	지수옵션 전체	1,156,605	385.2	2,154,734
Put	533,027	221.0	1,283,275	18.6%	PCR(금액기준)	1.35	VKOSPI	19.56%(+0.67%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	0.70	-1.04	95,258	29,269	3,724	17.2	Put	325.0(K+1)	10.25	3.87	719	9,686	-140	18.0
	327.5(K+2)	1.05	-1.43	72,965	17,481	1,238	17.2		322.5(K+0)	8.43	3.39	1,777	6,524	-216	18.0
	325.0(K+1)	1.53	-1.86	61,889	25,682	3,045	17.2		320.0(K-1)	6.88	2.97	7,676	14,862	-130	18.4
	322.5(K+0)	2.17	-2.38	44,647	12,793	2,296	17.2		317.5(K-2)	5.41	2.40	12,657	13,059	-271	18.4
	320.0(K-1)	3.07	-2.86	19,176	22,369	3,104	17.5		315.0(K-3)	4.18	1.92	25,051	25,087	530	18.5

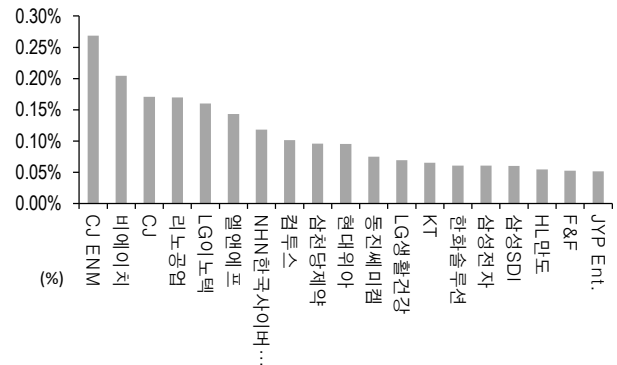
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,399,617	2,397.2	4,377,767	98,947	-103,324	76,746	26,689	-8.5	37.3	-27.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
메리츠증권	6,540	-5.22	10.2	92.3	83,160	22,535	-0.64%	-40,480	16,904	23,576	15,746	702
현대차	174,300	-2.35	67.4	89.4	31,956	-1,212	-0.02%	1,930	-2,563	648	535	62
영원무역	44,350	-1.88	1.6	80.5	2,663	44	-0.32%	148	16	-164	-164	0
삼성전자	61,500	-1.44	520.2	71.5	1,135,429	11,093	0.06%	22,439	16,437	-37,749	-39,249	1,341
LG 전자	111,500	-2.11	53.6	69.5	48,334	251	0.01%	2,173	2,312	-4,278	368	-1,702
SK 하이닉스	89,500	-2.19	136.5	66.6	133,833	5,307	0.00%	1,417	11,372	-12,738	-6,474	2,185
LG 이노텍	286,500	-2.55	38.2	65.1	23,660	876	0.16%	1,438	110	-1,549	-990	-454
삼성전기	147,100	-2.13	27.2	64.2	13,039	178	0.01%	576	238	-816	-1,065	244
한국금융지주	59,400	-3.10	9.2	61.4	26,536	131	-0.02%	824	205	-952	-253	-354
LG 화학	668,000	-2.62	70.5	56.5	7,181	32	0.04%	-164	-97	311	254	70

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터