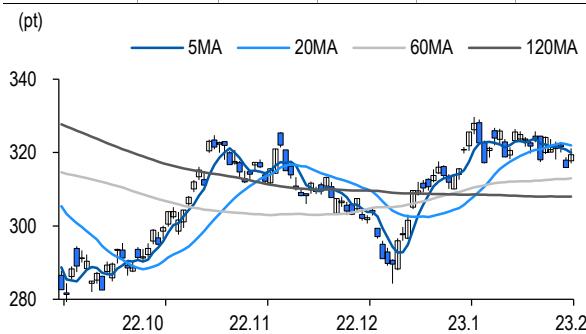


선물옵션시장 지표

2023.2.24

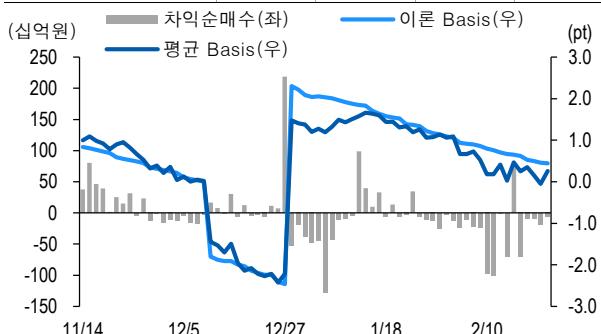
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	319.44	1.11	3.50	5,586.7	-
선물 3월물	320.10	1.23	3.90	20,840.8	311,405
선물 6월물	321.80	1.21	3.85	78.9	41,211
3월물(mini)	320.10	1.23	3.94	1,313.1	42,343
4월물(mini)	320.16	1.22	3.86	5.4	15,370



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.44	0.26	0.66	-0.06%
베이시스(mini)	0.44	0.26	0.66	-0.06%
제1스프레드(SP)	2.02	1.83	1.85	-0.06%
합성선물 베이시스(ATM)	0.44	0.65	0.65	0.07%



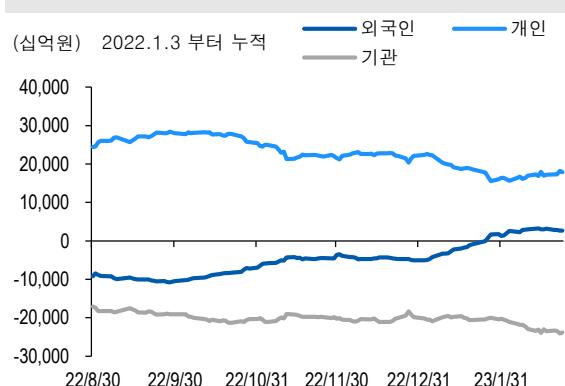
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	8.6	-12.1	-3.5	0.1	-11.5	442.8	58.3	-1.2	-3.6	-1.6
개인	-331.4	43.8	-287.6	0.0	11.7	-142.0	-43.8	-0.4	0.5	7.1
기관	290.9	-30.7	260.1	-6.6	-44.6	-259.0	-16.9	1.9	2.9	-7.5
금융투자	241.8	-57.9	183.9	-4.7	4.8	-724.3	-20.7	2.2	3.0	-26.1
투신	22.0	-3.6	18.4	0.0	-16.9	479.1	3.8	-0.3	-0.1	17.8
은행+보험+기타금융	7.4	45.5	52.9	0.0	-13.8	-13.5	0.0	0.0	0.0	-0.1
연기금+국가지자체	-6.7	-19.3	-26.0	-0.1	-12.2	-0.3	0.0	0.0	0.0	0.9
기타법인	31.9	-3.9	28.0	0.0	1.5	-41.7	2.3	-0.2	0.1	2.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)									
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정	
Call	643,367	218.7	904,359	17.4%	지수옵션 전체		1,194,294	387.5	2,229,059
Put	550,927	168.8	1,324,700	18.6%	PCR(금액기준)		0.77	VKOSPI	18.99%(-0.57%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	322.5(K+3)	3.35	1.18	44,659	13,125	332	17.5	317.5(K+1)	3.39
	320.0(K+2)	4.51	1.44	26,263	23,910	1,541	17.6	315.0(K+0)	2.50
	317.5(K+1)	5.95	1.83	10,246	10,091	1,060	18.1	312.5(K-1)	1.87
	315.0(K+0)	7.59	2.19	2,192	10,157	-42	18.5	310.0(K-2)	1.37
	312.5(K-1)	9.43	2.51	337	2,747	56	19.0	307.5(K-3)	0.99
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	317.5(K+1)	3.39	-2.02	19,891	13,674	615	17.4	315.0(K+0)	2.50
	315.0(K+0)	2.50	-1.68	36,544	25,128	41	17.7	312.5(K-1)	1.87
	312.5(K-1)	1.87	-1.37	48,119	21,237	900	18.3	310.0(K-2)	1.37
	310.0(K-2)	1.37	-1.05	63,401	40,143	3,215	18.8	307.5(K-3)	0.99
	307.5(K-3)	0.99	-0.82	60,177	23,399	2,673	19.2		

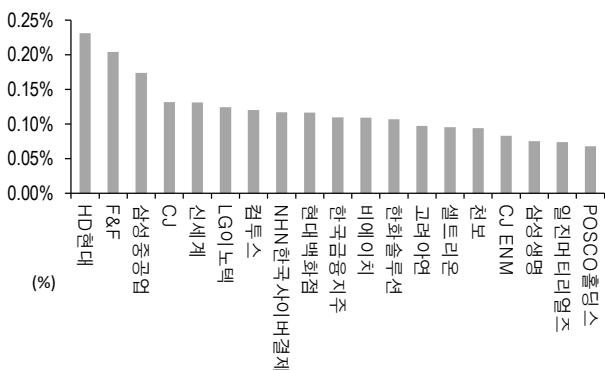
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,529,850	2,415.9	4,408,057	30,290	29,069	-12,111	-22,156	-1.6	7.1	-7.5
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	176,600	1.32	65.8	83.7	29,115	-2,841	-0.05%	-2,148	-398	2,547
메리츠증권	6,660	1.83	7.3	82.7	77,967	-5,193	-0.47%	4,510	-7,109	2,599
현대제철	37,800	-0.40	21.4	78.9	29,634	-3,234	-0.08%	-3,798	-4,836	8,629
삼성전자	62,200	1.14	577.4	72.0	1,121,657	-13,772	0.07%	15,825	16,688	-35,161
LG 이노텍	290,500	1.40	29.4	69.5	23,357	-303	0.12%	-47	-363	410
LG 화학	671,000	0.45	56.5	66.3	7,462	281	0.06%	12	3	-17
삼성전기	150,400	2.24	32.1	65.6	12,701	-338	-0.03%	648	-814	165
포스코케미칼	218,000	-0.68	117.0	65.0	39,677	142	0.02%	2,016	-852	-700
NAVER	214,000	1.18	77.5	64.8	30,087	1,353	0.05%	1,240	-895	-370
SK 하이닉스	92,800	3.69	212.9	63.3	143,222	9,389	-0.01%	-4,144	-14,231	18,322

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터