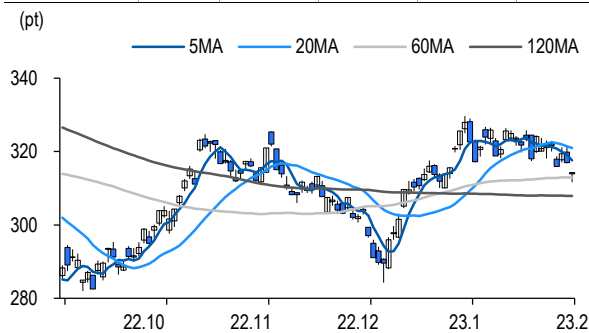


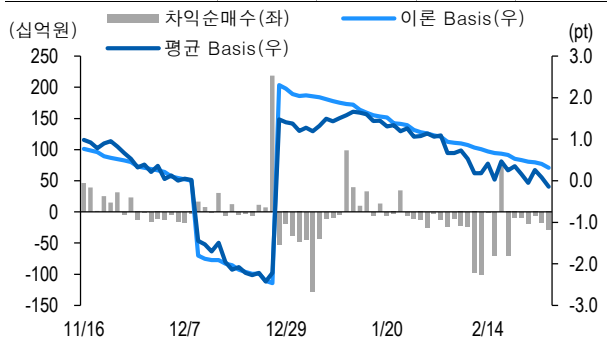
## 선물옵션시장 지표

2023.2.28

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.94	-0.95	-3.00	4,796.3	-
선물 3월물	314.00	-1.16	-3.70	19,799.5	324,498
선물 6월물	315.75	-1.16	-3.70	211.1	45,571
3월물(mini)	314.00	-1.16	-3.74	1,243.5	46,635
4월물(mini)	314.12	-1.18	-3.74	8.3	16,223



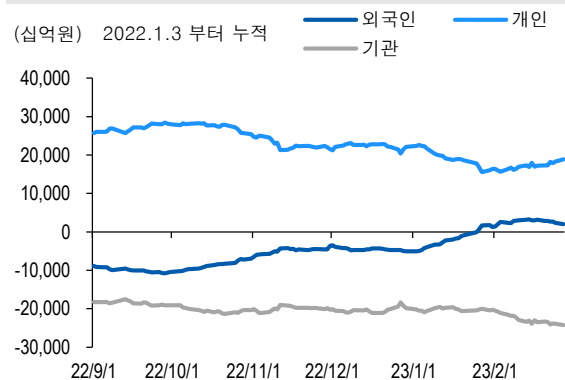
차익거래 관련 Market data	(pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스	0.31	-0.14	0.06	-0.14%	
베이스(mini)	0.31	-0.14	0.06	-0.14%	
제1스프레드(SP)	1.99	1.80	1.80	-0.06%	
합성선물 베이스(ATM)	0.31	0.05	0.05	-0.08%	



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-321.7	-52.0	-373.7	0.1	-81.1	-165.7	-32.5	-0.2	6.2	-7.5
개인	675.7	-49.4	626.3	0.0	-0.5	-11.2	9.4	-3.7	-1.3	15.5
기관	-419.9	102.3	-317.6	-29.6	10.5	172.6	22.5	3.6	-4.3	-8.7
금융투자	-450.1	16.1	-434.0	-28.6	-16.2	246.3	23.7	4.1	-4.4	4.1
투신	24.6	4.5	29.1	0.0	37.2	-82.5	-1.3	-0.3	-0.5	-15.1
은행+보험+기타금융	10.8	45.7	56.5	0.0	1.4	10.5	0.0	-0.1	0.5	0.1
연기금+국가지자체	13.2	20.0	33.2	1.6	-9.1	-1.6	0.0	0.0	0.0	2.3
기타법인	66.0	-0.5	65.4	0.0	0.1	4.2	0.6	0.3	-0.6	0.7

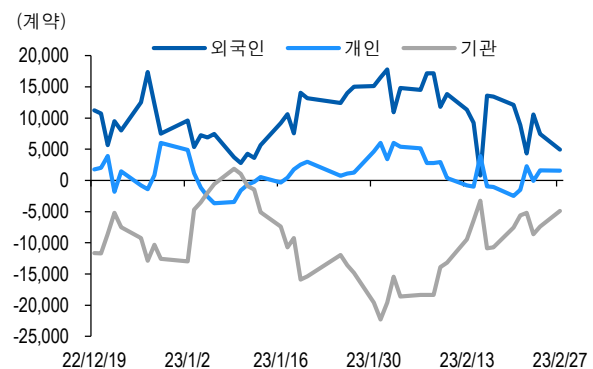
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

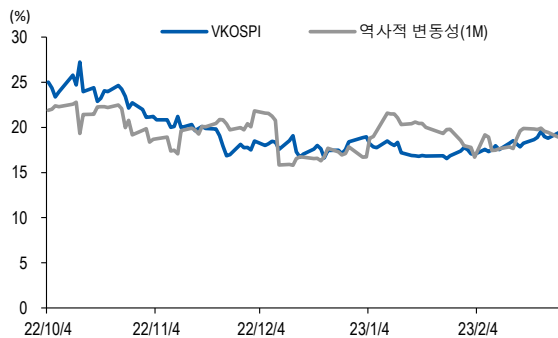
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	740,998	193.4	960,415	17.2%	지수옵션 전체	1,441,795	450.5	2,333,964
Put	700,797	257.1	1,373,549	19.4%	PCR(금액기준)	1.33	VKOSPI	19.38%(+0.57%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	0.61	-0.81	101,513	28,342	1,511	17.1	Put	320.0(K+1)	7.63	2.21	1,798	15,407	-388	19.0
	322.5(K+2)	1.01	-1.15	93,730	16,871	2,022	17.2		317.5(K+0)	5.93	1.81	5,747	13,922	-637	18.9
	320.0(K+1)	1.59	-1.53	103,500	27,927	3,633	17.2		315.0(K-1)	4.49	1.39	19,197	25,069	-991	18.9
	317.5(K+0)	2.42	-1.92	68,248	17,193	6,249	17.5		312.5(K-2)	3.32	1.02	38,170	22,318	640	19.1
	315.0(K-1)	3.49	-2.30	32,698	13,621	3,486	17.6		310.0(K-3)	2.42	0.77	62,476	33,619	-7,362	19.5

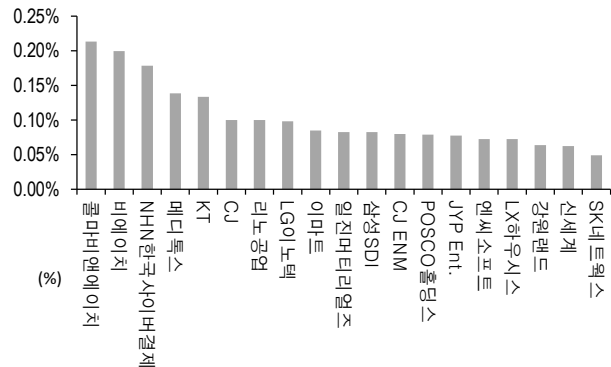
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	3,089,211	2,116.6	4,516,677	112,402	-68,595	22,135	45,305	-7.5	15.5	-8.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	173,500	-0.46	68.8	93.6	31,904	2,582	0.03%	1,302	1,493	-2,823	-2,191	-362
삼성전기	147,000	-0.27	24.7	84.9	12,433	193	0.00%	-41	919	-918	-766	-152
영진약품	3,250	-2.99	1.0	77.2	11,894	1,690	-0.06%	-309	276	33	33	0
삼성전자	60,700	-1.30	498.4	74.0	1,157,387	14,773	-0.07%	19,242	12,679	-32,529	-8,844	-4,298
한올바이오파마	15,430	-1.84	2.3	65.3	3,501	-199	-0.17%	-1,566	-57	1,624	1,624	0
현대건설	37,300	-1.84	7.9	65.0	14,518	73	-0.05%	-1,550	-138	1,688	1,984	-296
SK 하이닉스	90,200	-1.42	104.8	61.9	143,990	3,555	-0.03%	-6,547	9,326	-3,003	44	-1,185
일진머티리얼즈	61,900	0.49	9.0	61.7	41,570	-431	0.08%	1,172	-666	-506	279	-785
엔씨소프트	432,000	-1.82	17.9	60.0	4,964	70	0.07%	320	23	-343	-329	-14
삼성 SDI	676,000	-0.73	67.3	60.0	13,119	99	0.08%	439	127	-566	-811	220

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터