

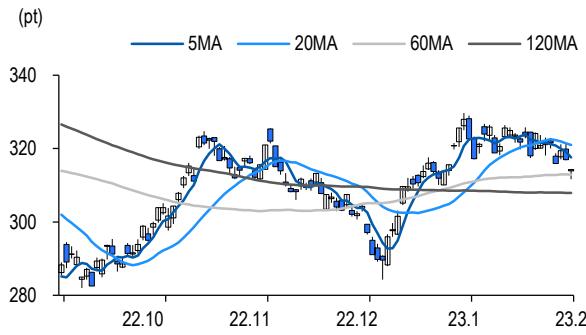


선물옵션시장 지표

2023.2.28

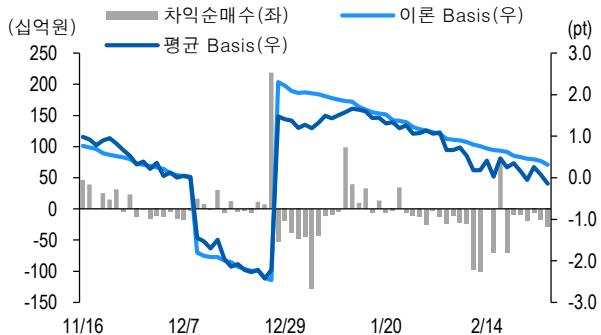
Market Data (십억원, 계약)

	종가(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 베이시스	0.31	-0.14	0.06	-0.14%
베이시스(mini)	0.31	-0.14	0.06	-0.14%
제1스프레드(SP)	1.99	1.80	1.80	-0.06%
합성선물 베이시스(ATM)	0.31	0.05	0.05	-0.08%



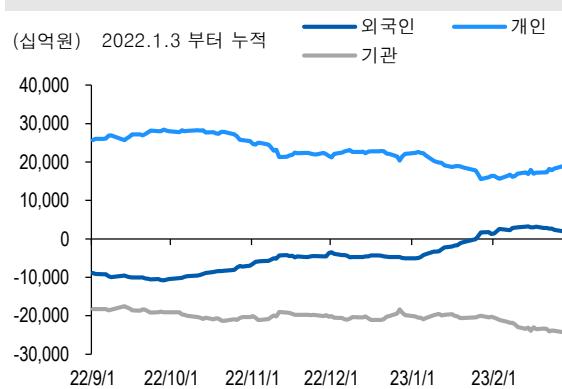
투자주체별 매매 동향

(십억원)

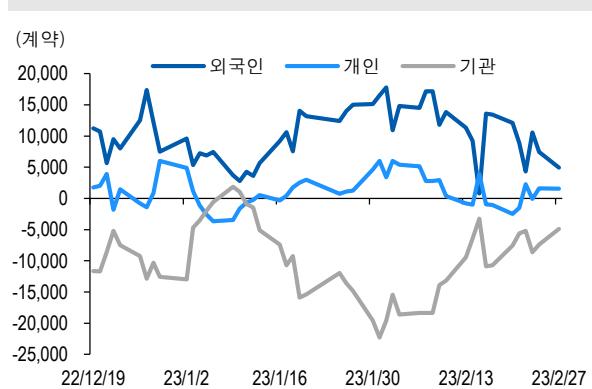
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-321.7	-52.0	-373.7	0.1	-81.1	-165.7	-32.5	-0.2	6.2	-7.5
개인	675.7	-49.4	626.3	0.0	-0.5	-11.2	9.4	-3.7	-1.3	15.5
기관	-419.9	102.3	-317.6	-29.6	10.5	172.6	22.5	3.6	-4.3	-8.7
금융투자	-450.1	16.1	-434.0	-28.6	-16.2	246.3	23.7	4.1	-4.4	4.1
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



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

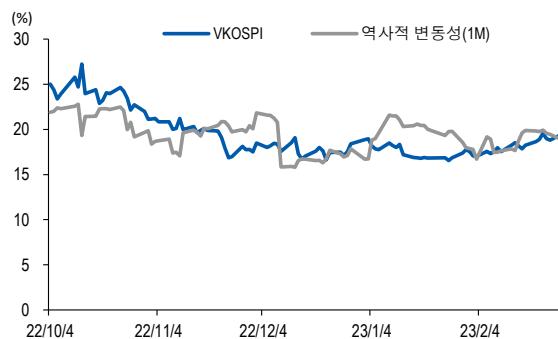
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	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)
Call	325.0(K+3)	0.61	-0.81	101,513	28,342	1,511	17.1	
	322.5(K+2)	1.01	-1.15	93,730	16,871	2,022	17.2	
	320.0(K+1)	1.59	-1.53	103,500	27,927	3,633	17.2	
	317.5(K+0)	2.42	-1.92	68,248	17,193	6,249	17.5	
	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	
Put								
행사가								
종가								
등락(pt)								
거래량								
미결제약정								
미결제증감								
내재변동성								

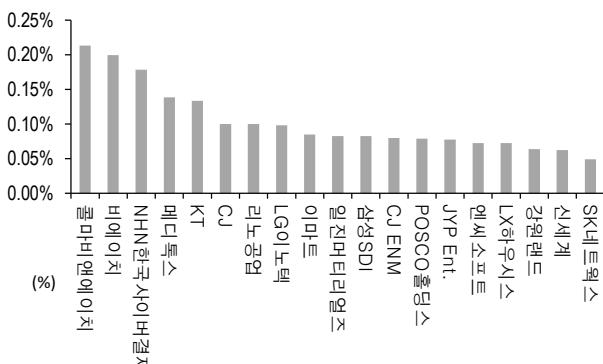
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	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(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	173,500	-0.46	68.8	93.6	31,904	2,582	0.03%	1,302	1,493	-2,823
삼성전기	147,000	-0.27	24.7	84.9	12,433	193	0.00%	-41	919	-918
영진약품	3,250	-2.99	1.0	77.2	11,894	1,690	-0.06%	-309	276	33
삼성전자	60,700	-1.30	498.4	74.0	1,157,387	14,773	-0.07%	19,242	12,679	-32,529
한울바이오파마	15,430	-1.84	2.3	65.3	3,501	-199	-0.17%	-1,566	-57	1,624
현대건설	37,300	-1.84	7.9	65.0	14,518	73	-0.05%	-1,550	-138	1,688
SK 하이닉스	90,200	-1.42	104.8	61.9	143,990	3,555	-0.03%	-6,547	9,326	-3,003
일진마티리얼즈	61,900	0.49	9.0	61.7	41,570	-431	0.08%	1,172	-666	-506
엔씨소프트	432,000	-1.82	17.9	60.0	4,964	70	0.07%	320	23	-343
삼성 SDI	676,000	-0.73	67.3	60.0	13,119	99	0.08%	439	127	-566

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터