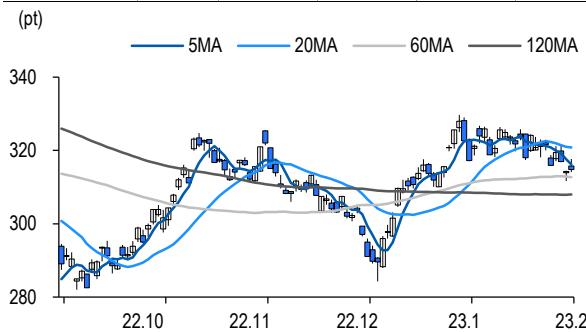


## 선물옵션시장 지표

2023.3.2

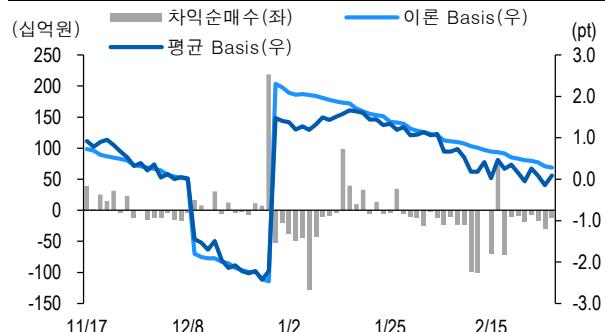
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	314.80	0.27	0.86	6,207.9	-
선물 3월물	315.80	0.57	1.80	18,205.6	318,612
선물 6월물	317.55	0.57	1.80	213.3	45,458
3월물(mini)	315.86	0.59	1.86	1,368.4	49,107
4월물(mini)	315.76	0.52	1.64	12.6	16,541



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.28	0.09	1.00	-0.06%
베이시스(mini)	0.28	0.09	1.06	-0.06%
제1스프레드(SP)	2.00	1.78	1.80	-0.07%
합성선물 베이시스(ATM)	0.28	0.93	0.93	0.21%



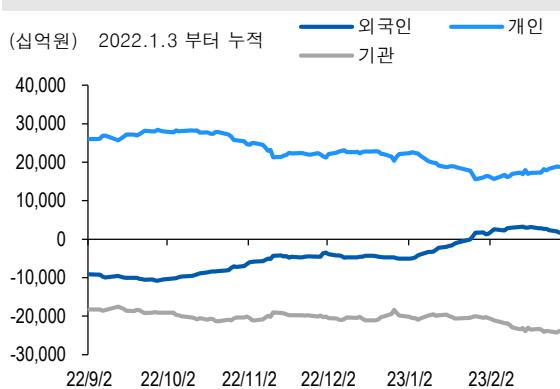
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

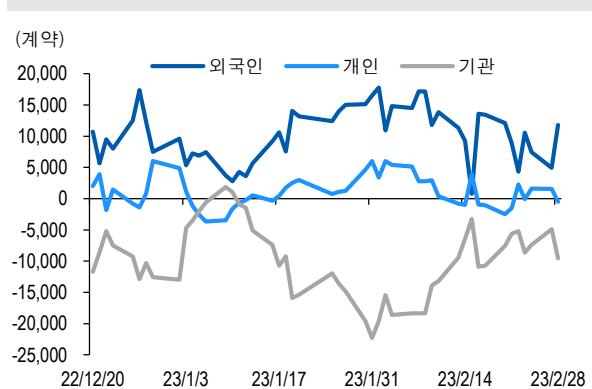
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-290.4	-2.2	-292.6	0.0	-271.5	547.2	-2.2	5.2	-2.5	17.7
개인	-143.1	21.0	-122.1	0.0	1.4	-166.1	4.6	-4.5	1.5	-4.9
기관	410.1	-26.6	383.5	-11.6	47.8	-363.7	-2.3	-0.4	0.3	-12.2
금융투자	260.9	16.0	276.9	-11.6	1.3	-660.4	-1.8	-0.4	0.7	-21.0
투신	69.1	-0.8	68.3	0.0	31.8	320.2	-0.5	0.0	-0.1	8.7
은행+보험+기타금융	6.2	-57.4	-51.2	0.0	-6.1	-20.6	0.0	0.0	-0.3	0.6
연기금+국가지자체	43.7	-0.1	43.6	0.0	8.8	-2.9	0.0	0.0	0.0	-0.5
기타법인	23.4	-2.5	20.9	0.0	0.0	-17.5	0.0	-0.3	0.6	-0.6

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	739,084	202.1	993,707	17.1%	지수옵션 전체	1,415,199	382.2	2,397,124							
Put	676,115	180.1	1,403,417	17.1%	PCR(금액기준)	0.89	VKOSPI	18.53%(-0.85%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	322.5(K+3)	1.02	0.01	113,362	18,663	1,792	16.9	Put	317.5(K+1)	4.26	-1.67	14,251	14,459	537	14.0
	320.0(K+2)	1.72	0.13	92,967	27,427	-500	17.4		315.0(K+0)	3.22	-1.27	43,415	25,626	557	15.8
	317.5(K+1)	2.67	0.25	40,483	17,055	-138	17.9		312.5(K-1)	2.25	-1.07	47,075	22,457	139	16.4
	315.0(K+0)	3.95	0.46	22,663	13,917	296	18.7		310.0(K-2)	1.55	-0.87	89,900	35,439	1,820	17.1
	312.5(K-1)	5.50	0.68	5,601	6,247	365	19.6		307.5(K-3)	1.05	-0.66	89,082	17,969	88	17.8

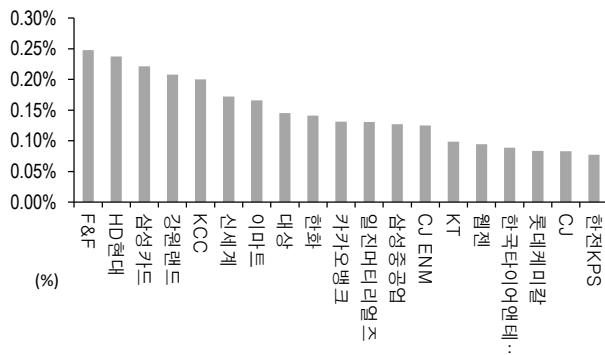
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	2,967,077	2,246.8	4,533,758	17,081	46,628	-25,742	-20,504	17.7	-4.9	-12.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
영진약품	3,255	0.15	0.7	88.5	10,331	-1,563	-0.03%	2,943	77	-3,020
넥센타이어	7,520	-0.13	0.4	79.1	12,911	-1,355	-0.21%	1,396	-75	-1,321
현대차	176,600	1.79	100.7	74.9	29,298	-2,606	-0.03%	-2,642	-1,393	4,033
삼성전자	61,000	0.49	517.4	72.0	1,167,293	9,906	0.00%	3,127	-12,851	10,084
일진미티리얼즈	63,800	3.07	13.8	61.5	41,889	319	0.13%	855	1,008	-1,873
SK 하이닉스	89,300	-1.00	109.0	60.4	141,620	-2,370	0.01%	3,118	315	-3,382
엔씨소프트	434,500	0.58	21.0	50.3	5,042	78	0.05%	303	286	-601
LG 전자	111,600	-1.06	36.0	49.9	44,123	-2,611	-0.02%	1,614	-4,043	2,386
삼성 SDI	696,000	2.96	90.9	49.0	13,551	432	0.01%	716	-334	-382
한울바이오파마	15,530	0.65	0.9	48.8	3,648	147	-0.30%	671	-473	-198

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터