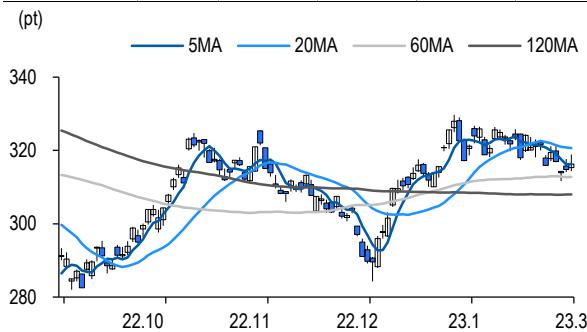


선물옵션시장 지표

2023.3.3

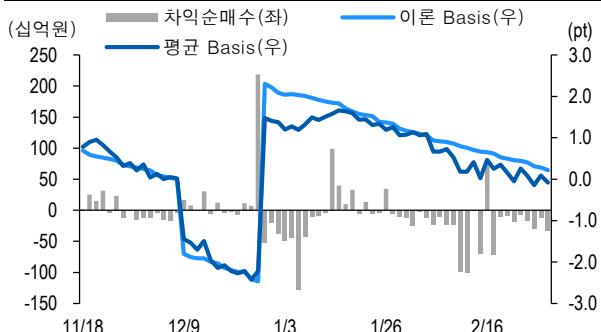
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.26	0.46	1.46	6,519.6	-
선물 3월물	315.30	-0.16	-0.50	22,903.6	319,453
선물 6월물	317.10	-0.14	-0.45	282.6	45,867
3월물(mini)	315.30	-0.16	-0.56	1,643.8	50,862
4월물(mini)	315.62	-0.04	-0.14	14.2	16,600



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.22	-0.08	-0.96	-0.09%
베이시스(mini)	0.22	-0.08	-0.96	-0.09%
제1스프레드(SP)	2.01	1.81	1.75	-0.06%
합성선물 베이시스(ATM)	0.22	-0.93	-0.93	-0.36%



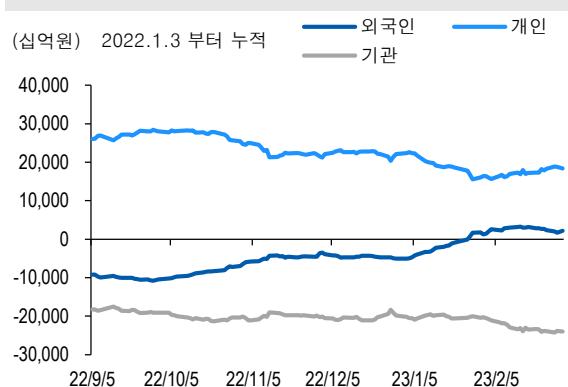
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	480.1	0.7	480.8	0.2	395.3	-269.3	-31.0	3.2	-0.7	8.7
개인	-404.3	37.7	-366.6	0.0	1.5	178.3	-12.0	-1.6	-0.8	6.4
기관	-90.2	-8.0	-98.2	-33.7	-31.3	-1.4	43.8	-0.6	2.0	-14.1
금융투자	-263.6	-43.4	-307.0	-30.5	11.5	74.2	43.4	0.6	2.0	-17.8
투신	59.1	16.9	75.9	-0.1	8.1	-104.2	0.4	-0.4	-0.1	-1.6
은행+보험+기타금융	26.2	-51.0	-24.8	0.0	-4.3	22.8	0.0	-0.9	0.0	0.1
연기금+국가지자체	5.1	19.7	24.8	-1.5	-28.6	5.7	0.0	0.0	0.0	5.3
기타법인	14.4	13.3	27.7	0.0	0.4	92.4	-0.8	-0.9	-0.4	-1.0

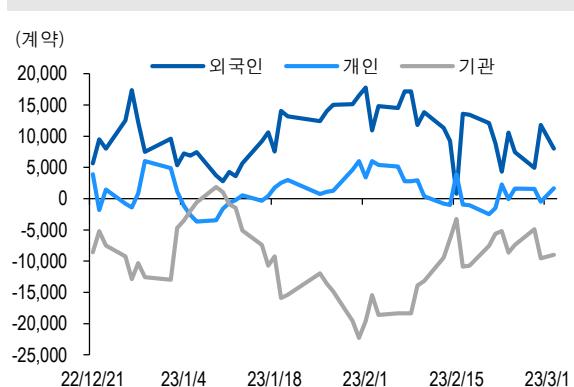
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	966,115	226.7	1,040,171	13.9%	지수옵션 전체	1,796,569	427.5	2,489,076						
Put	830,454	200.8	1,448,905	19.5%	PCR(금액기준)	0.89	VKOSPI	18.31%(-0.22%p)						
<hr/>														
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
Call	322.5(K+3)	0.66	-0.36	154,041	23,344	4,681	14.0	317.5(K+1)	4.24	-0.02	22,642	16,129	1,670	19.9
	320.0(K+2)	1.24	-0.48	116,935	26,670	-757	14.0	315.0(K+0)	2.95	-0.27	69,001	26,764	1,138	19.6
	317.5(K+1)	2.10	-0.57	68,287	21,089	4,034	13.7	312.5(K-1)	1.93	-0.32	78,240	24,799	2,342	19.3
	315.0(K+0)	3.28	-0.67	18,867	14,411	494	13.2	310.0(K-2)	1.24	-0.31	137,628	36,011	572	19.4
	312.5(K-1)	4.78	-0.72	4,472	6,319	72	12.0	307.5(K-3)	0.76	-0.29	111,502	21,645	3,676	19.6

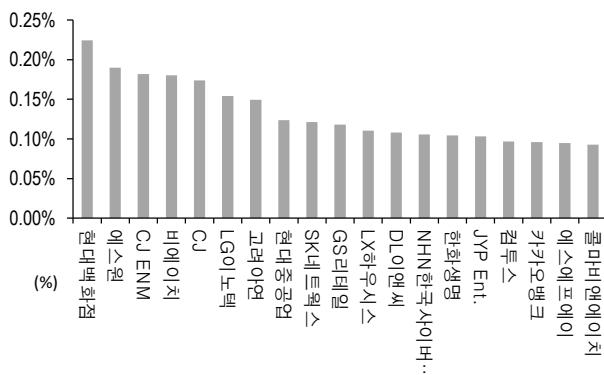
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,497,228	2,603.2	4,583,138	49,380	15,954	14,754	-27,658	8.7	6.4	-14.1

종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수
영진약품	3,230	-0.77	1.5	103.2	9,854	-477	-0.12%	-5,044	1,718	3,326	3,326	0
현대차	178,400	1.02	112.9	87.5	28,451	-847	-0.01%	-1,717	2,197	-471	-662	131
SK 하이닉스	88,000	-1.46	158.3	65.2	146,723	5,103	0.02%	2,221	-2,380	159	-1,816	-399
LG 전자	111,700	0.09	34.0	63.0	43,943	-180	0.02%	483	238	-731	68	-757
LG 화학	676,000	-0.15	72.0	60.9	7,270	-599	-0.02%	-116	-11	127	135	-8
삼성전자	60,800	-0.33	461.8	58.1	1,185,050	17,757	0.05%	26,997	-15,797	-11,378	-11,407	-1,864
현대엘리베이	27,400	-0.54	1.0	55.4	3,010	270	-0.06%	143	105	-247	-247	0
삼성전기	144,300	-0.14	18.7	52.8	12,138	-12	-0.07%	-1,021	238	780	578	202
롯데케미칼	184,000	3.02	17.0	52.1	8,427	-773	0.04%	183	567	-750	-1,125	375
일진마티리얼즈	63,700	-0.16	11.3	51.6	42,417	528	0.01%	-348	614	-266	-826	560

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터