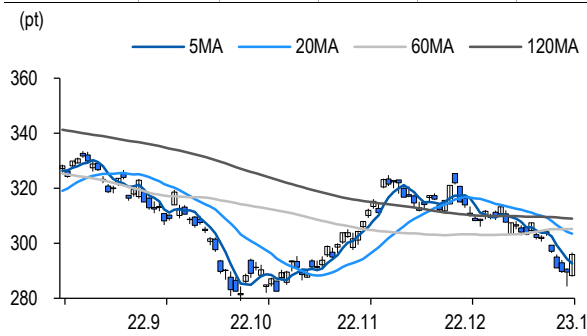


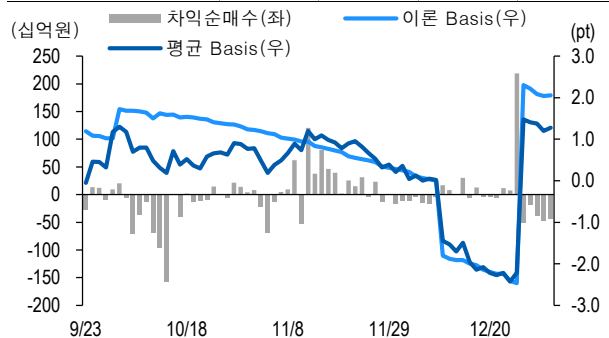
## 선물옵션시장 지표

2023.1.5

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	295.98	2.21	6.40	5,142.8	-
선물 3월물	297.00	2.08	6.05	25,354.9	307,724
선물 6월물	298.85	2.07	6.05	30.6	24,148
1월물(mini)	295.70	2.07	6.00	1,418.2	88,891
2월물(mini)	296.38	2.07	6.00	19.3	9,637



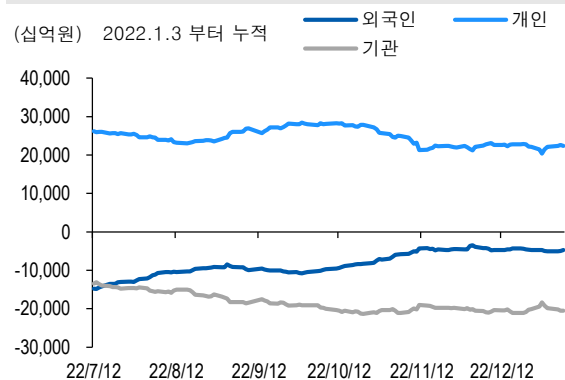
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	2.06	1.28	1.02	-0.26%
베이스(mini)	0.26	-0.05	-0.28	-0.10%
제1스프레드(SP)	2.11	1.72	1.75	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.26	-0.31	-0.31	-0.19%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	260.8	-24.0	236.8	4.8	225.4	118.1	16.1	9.3	2.1	-14.5
개인	-296.9	48.9	-248.0	0.0	3.0	-134.0	-35.6	-5.2	-2.0	-14.0
기관	0.7	-22.9	-22.2	-48.8	33.3	65.5	24.2	-5.1	-0.4	28.0
금융투자	-189.6	140.5	-49.1	-30.9	-2.4	-602.6	18.6	-5.4	0.5	6.9
투신	123.2	-10.7	112.5	0.0	60.0	671.6	5.0	-0.1	0.0	19.4
은행+보험+기타금융	6.8	-188.2	-181.4	0.0	7.4	13.9	0.6	0.0	-0.8	0.4
연기금+국가자재	39.5	-1.5	38.0	-0.3	-15.0	-17.5	0.0	0.4	-0.1	1.3
기타법인	35.4	-2.0	33.4	0.0	0.7	-49.6	-4.7	1.1	0.3	0.5

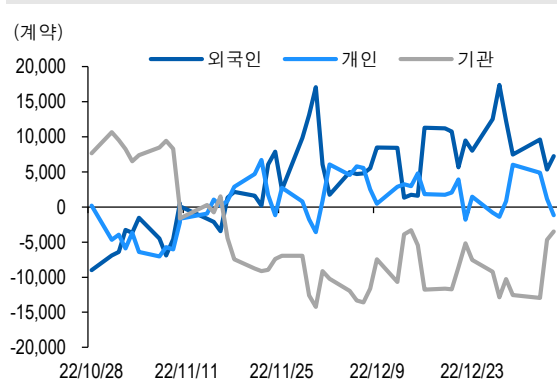
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

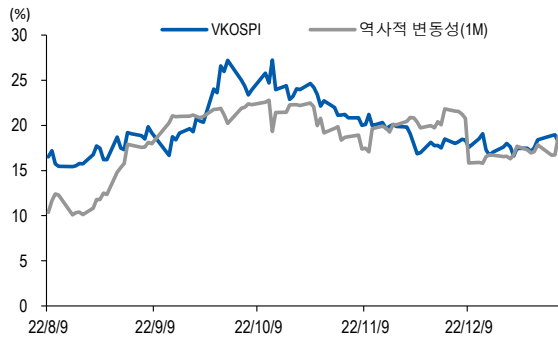
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,133,239	308.9	1,055,685	14.9%	지수옵션 전체	2,120,439	515.1	2,452,343
Put	987,200	206.2	1,396,658	19.2%	PCR(금액기준)	0.67	VKOSPI	18.17%(-0.79%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	297.5(K+3)	2.23	1.52	150,487	16,542	-339	15.1	Put	292.5(K+1)	1.81	-3.06	48,597	17,707	2,647	18.3
	295.0(K+2)	3.46	2.18	120,254	18,773	-385	15.0		290.0(K+0)	1.15	-2.32	86,931	24,286	5,283	18.6
	292.5(K+1)	4.97	2.87	64,048	12,881	662	14.5		287.5(K-1)	0.68	-1.70	90,621	24,745	1,298	18.7
	290.0(K+0)	6.82	3.61	28,896	12,622	-459	13.9		285.0(K-2)	0.41	-1.18	140,635	23,391	2,572	19.2
	287.5(K-1)	8.88	4.25	7,487	6,712	-122	11.8		282.5(K-3)	0.24	-0.81	120,620	25,751	2,743	19.7

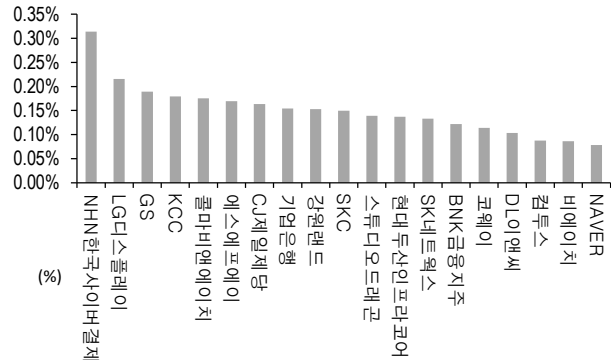
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	4,192,879	2,519.9	4,593,461	-26,544	46,310	-57,714	10,767	-14.5	-14.0	28.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	160,000	0.31	60.0	81.4	47,010	-183	-0.30%	-3,322	585	2,720	2,420	40
LX 하우스시스	31,200	1.96	0.2	80.6	452	72	-0.01%	31	-72	41	41	0
일진머티리얼즈	53,200	2.70	9.9	78.9	32,643	355	-0.05%	326	-148	-178	-167	-11
삼성전자	57,900	4.32	762.4	66.8	1,090,915	-88,733	-0.06%	-20,220	-21,532	41,948	22,759	11,380
LG 화학	604,000	0.17	50.1	65.7	9,971	111	-0.04%	-372	155	217	322	-295
LG 이노텍	266,500	0.57	43.5	65.2	18,326	-843	-0.03%	-109	-391	490	530	-23
현대제철	30,750	1.32	6.9	63.7	41,949	26	0.06%	2,432	-318	-2,113	-1,014	-1,099
CJ CGV	16,850	-0.59	0.8	63.6	19,688	-1,088	-1.64%	-783	1,174	-391	-391	0
POSCO 홀딩스	275,000	0.92	37.4	63.0	19,193	-313	-0.03%	-266	175	73	-145	218
LG 전자	89,600	4.55	32.1	62.6	39,272	3,645	-0.27%	2,090	-5,758	3,669	3,114	555

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터