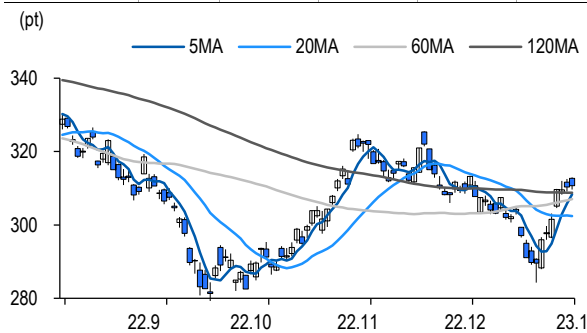


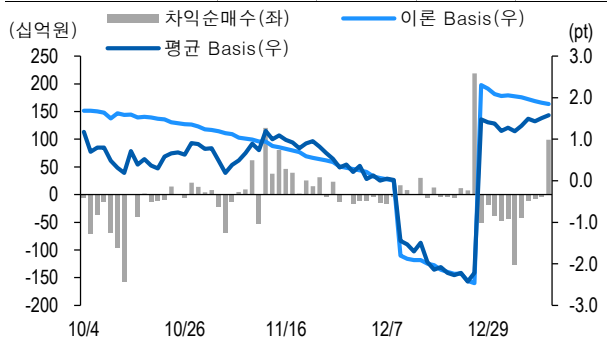
## 선물옵션시장 지표

2023.1.13

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	310.70	0.10	0.32	5,878.1	-
선물 3월물	313.30	0.42	1.30	19,043.7	304,866
선물 6월물	315.35	0.48	1.50	34.2	24,989
1월물(mini)	311.58	0.39	1.20	649.4	0
2월물(mini)	312.50	0.48	1.50	792.9	25,357



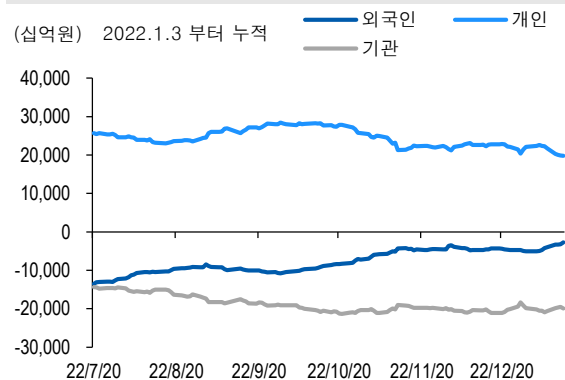
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.84	1.58	2.60	-0.09%
베이스(mini)	0.00	-0.04	0.88	-0.01%
제1스프레드(SP)	2.19	2.00	2.00	-0.06%
합성선물 베이스(ATM)	0.00	0.91	0.91	0.29%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	484.2	22.9	507.0	102.9	352.8	-63.1	11.1	-3.6	-2.6	-0.4
개인	-48.9	-16.3	-65.1	0.0	0.3	51.2	-16.1	4.0	0.5	12.8
기관	-437.0	16.4	-420.6	-4.0	-294.5	-52.9	7.7	-1.6	1.8	-12.4
금융투자	-417.3	2.0	-415.3	-5.8	-335.1	33.0	12.0	-0.3	1.6	65.1
투신	30.1	6.6	36.6	0.2	40.9	-72.7	-0.8	-0.9	0.1	-53.1
은행+보험+기타금융	7.9	-3.9	4.0	0.0	10.7	-15.5	-3.5	-0.4	0.0	1.1
연기금+국가자재	-59.6	1.0	-58.6	1.6	-27.4	2.3	0.0	0.0	0.0	-25.6
기타법인	1.7	-23.0	-21.4	0.0	-2.6	64.8	-2.7	1.3	0.3	-0.1

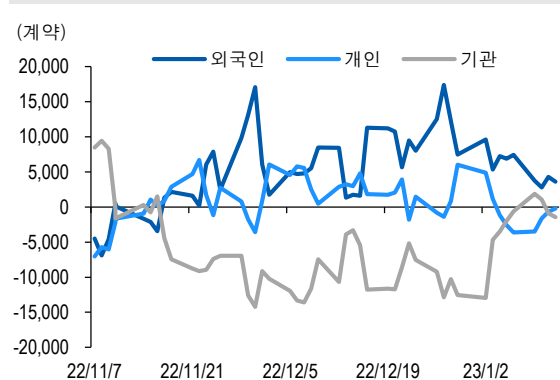
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

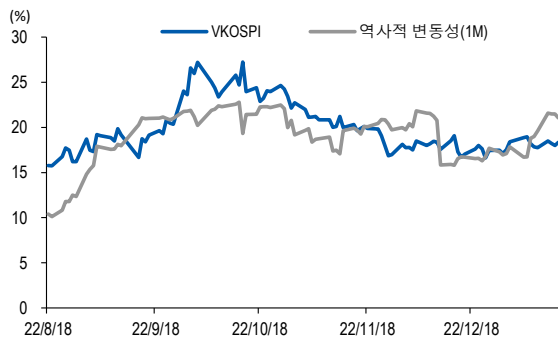
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,021,870	327.7	590,626	14.5%	지수옵션 전체	3,713,860	608.9	1,468,432
Put	1,691,990	281.2	877,806	7.7%	PCR(금액기준)	0.86	VKOSPI	18.34%(+0.36%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	0.01	-0.01	145,023	0	-48,633	17.7	Put	312.5(K+1)	1.03	-1.65	242,803	0	-10,966	8.7
	315.0(K+2)	0.01	-0.10	318,044	0	-56,287	11.9		310.0(K+0)	0.06	-1.04	811,368	0	-23,165	4.5
	312.5(K+1)	0.12	-0.38	857,829	0	-33,259	10.1		307.5(K-1)	0.01	-0.36	285,449	0	-27,159	9.5
	310.0(K+0)	1.67	0.24	470,341	0	-37,436	19.6		305.0(K-2)	0.01	-0.08	98,441	0	-38,839	15.7
	307.5(K-1)	4.13	0.95	72,506	0	-24,534	33.1		302.5(K-3)	0.01	-0.02	38,771	0	-49,606	21.6

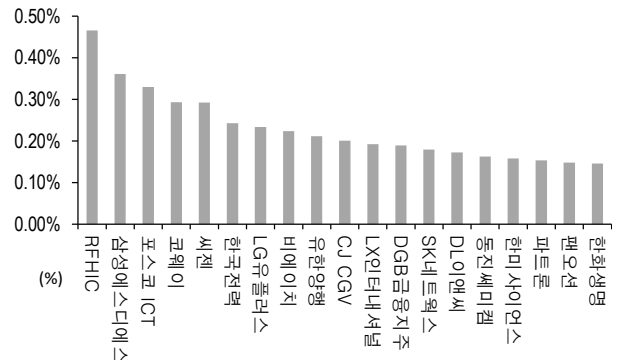
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	4,711,554	2,858.5	3,417,729	-1,441,763	44,516	34,135	-77,458	-0.4	12.8	-12.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
호텔신라	82,800	-1.19	22.2	63.8	0	-15,084	0.00%	789	3,004	-3,793	-1,204	-2,600
천보	222,200	-0.09	4.4	55.3	0	-2,567	0.05%	-56	3	53	303	0
삼성전자	60,600	-0.16	401.4	41.4	0	-332,265	-0.02%	16,270	36,584	-53,178	-10,571	-13,300
삼성전기	144,500	-0.69	22.0	37.6	0	-14,469	0.01%	-909	857	-16	803	-837
JYP Ent.	65,600	0.00	10.7	37.4	0	-8,121	-0.19%	-188	479	-291	3,459	0
SK 하이닉스	87,000	-0.23	95.1	36.3	0	-132,520	-0.06%	-18,039	7,614	10,717	23,703	1,769
한국전력	19,800	1.54	16.7	35.3	0	-88,752	0.24%	6,011	-724	-6,573	-18,825	-25,899
카카오	61,800	-0.48	42.5	31.4	0	-70,211	-0.15%	-3,468	-2,690	6,784	9,320	8,004
아모레퍼시픽	139,500	-3.13	14.9	29.0	0	-11,085	-0.04%	-781	2,480	-1,699	-1,024	-1,761
GS	43,800	1.39	1.9	28.4	0	-12,851	0.00%	634	-199	-527	-435	-136

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터