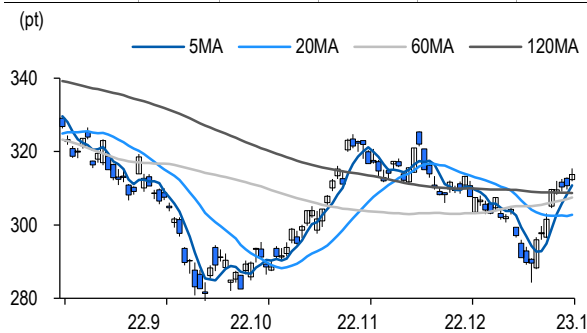


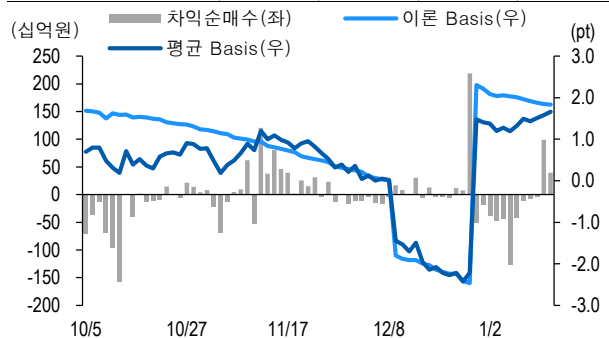
선물옵션시장 지표

2023.1.16

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.77	0.99	3.07	5,438.5	-
선물 3월물	315.30	0.64	2.00	21,789.1	302,805
선물 6월물	317.15	0.57	1.80	37.3	25,354
2월물(mini)	314.46	0.63	1.96	1,517.9	33,202
3월물(mini)	315.16	0.59	1.78	6.9	2,174



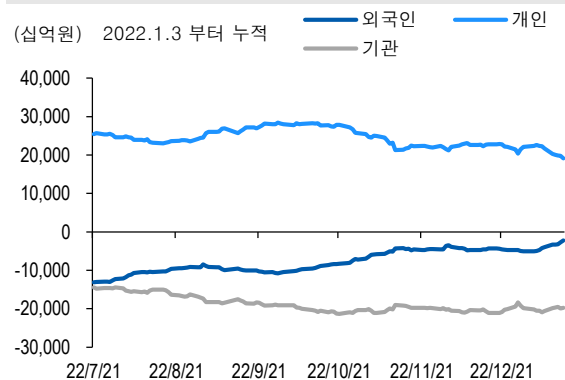
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.83	1.66	1.53	-0.06%
베이스스(mini)	0.90	0.88	0.69	-0.01%
제1스프레드(SP)	2.21	1.91	1.90	-0.09%
합성선물 베이스스(ATM)	0.90	0.60	0.60	-0.10%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	568.1	-20.9	547.3	34.4	430.4	13.7	-12.1	-0.8	-9.0	26.0
개인	-777.8	83.7	-694.1	0.0	2.5	-15.6	-11.0	-1.2	2.8	-15.3
기관	212.7	-67.9	144.7	5.2	-6.0	-57.3	23.0	2.1	6.3	-7.9
금융투자	159.4	-25.7	133.7	6.8	5.2	-275.4	23.6	2.1	5.4	64.6
투신	22.9	7.4	30.4	0.0	5.9	177.9	-0.6	0.0	-0.1	-44.0
은행+보험+기타금융	4.8	-54.4	-49.6	0.0	-6.7	42.6	0.0	0.0	1.1	-0.1
연기금+국가자재	30.4	-4.5	25.9	-1.6	-6.9	-2.4	0.0	0.0	0.0	-28.5
기타법인	-3.0	5.1	2.1	0.0	0.5	59.3	0.1	-0.1	-0.2	-2.8

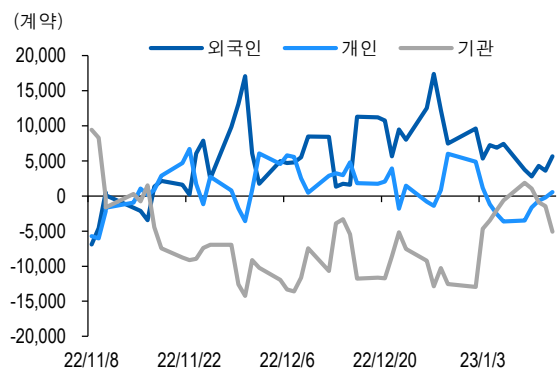
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



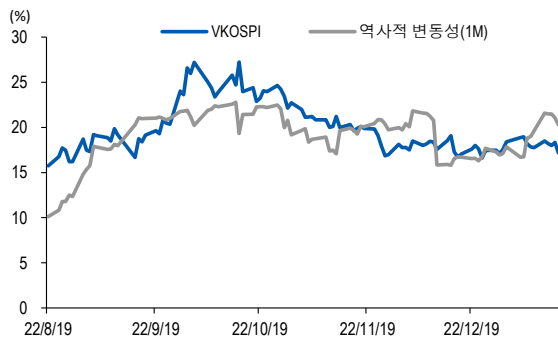
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	681,133	223.6	662,017	15.4%	지수옵션 전체	1,298,411	414.9	1,631,597
Put	617,278	191.3	969,580	17.0%	PCR(금액기준)	0.86	VKOSPI	17.19%(-1.15%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	4.06	0.33	14,931	6,788	623	15.3	Put	312.5(K+1)	4.71	-1.18	13,720	8,556	5,245	16.6
	315.0(K+2)	5.21	0.52	10,918	11,027	1,276	15.4		310.0(K+0)	3.68	-1.07	24,470	8,754	1,129	16.6
	312.5(K+1)	6.56	0.72	7,293	11,178	1,235	15.6		307.5(K-1)	2.87	-0.95	39,810	6,287	3,906	16.8
	310.0(K+0)	8.05	0.77	2,227	7,426	-42	15.6		305.0(K-2)	2.18	-0.86	45,025	7,898	3,631	16.9
	307.5(K-1)	9.82	1.18	537	4,229	-131	16.0		302.5(K-3)	1.73	-0.63	45,273	7,540	2,486	17.4

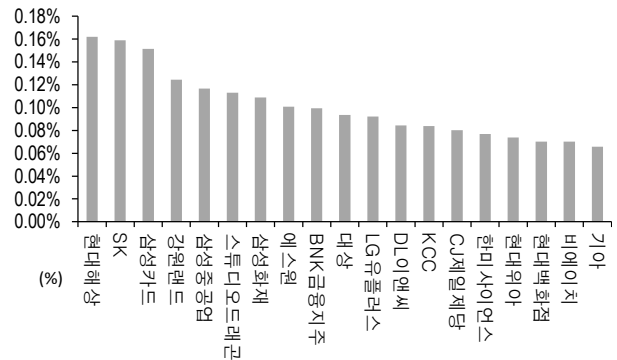
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,748,803	2,226.1	3,758,010	340,281	80,375	-565	-79,643	26.0	-15.3	-7.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
메디톡스	130,000	2.04	6.6	126.5	1,047	81	-0.69%	71	11	-82	-82	0
SK 하이닉스	86,100	-1.03	159.8	90.9	159,645	-6,132	-0.08%	6,489	-964	-5,004	11,281	393
일진머티리얼즈	57,900	-1.70	9.5	83.5	33,783	1,747	-0.07%	541	1,078	-1,619	-1,582	-36
아모레퍼시픽	139,000	0.36	20.3	80.8	13,349	2,408	-0.25%	114	-1,741	1,627	2,913	229
삼성전자	61,000	0.49	607.3	80.0	1,002,701	-5,943	-0.06%	8,167	-23,043	14,696	48,443	-5,900
LG 전자	94,600	0.42	37.3	78.9	18,992	3,802	-0.08%	-555	2,312	-1,950	-482	-903
신세계	234,000	0.00	16.7	78.8	3,110	1,664	-0.28%	775	-650	345	1,835	0
호텔신라	82,100	-0.73	44.3	72.7	35,040	17,404	-0.37%	3,370	-7,648	7,003	15,898	856
메리츠증권	6,510	4.49	11.1	71.2	46,617	7,793	-0.72%	-138	8,957	-8,819	-13,785	-450
LG 이노텍	275,000	-1.26	31.4	68.9	19,201	1,757	-0.11%	-246	-1,618	1,846	1,846	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

