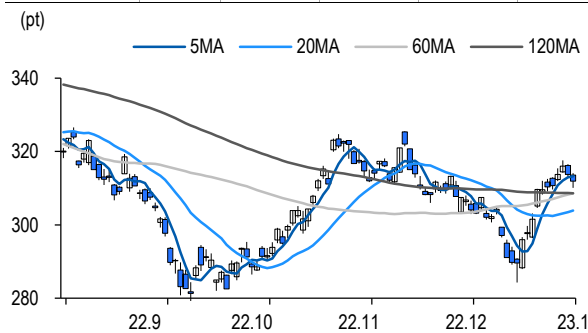


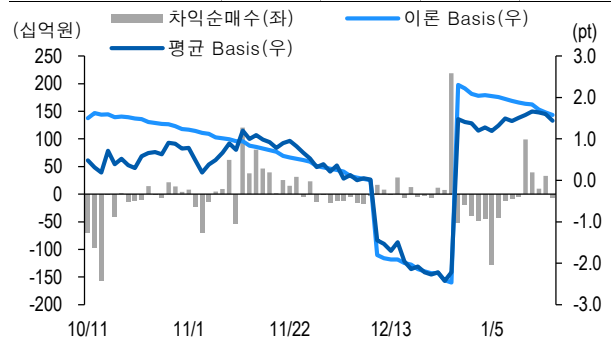
선물옵션시장 지표

2023.1.19

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	311.91	-0.59	-1.84	4,352.8	-
선물 3월물	313.70	-0.59	-1.85	19,897.7	308,621
선물 6월물	315.50	-0.55	-1.75	32.7	26,965
2월물(mini)	313.02	-0.55	-1.74	1,394.0	40,556
3월물(mini)	313.48	-0.66	-1.82	3.1	2,288



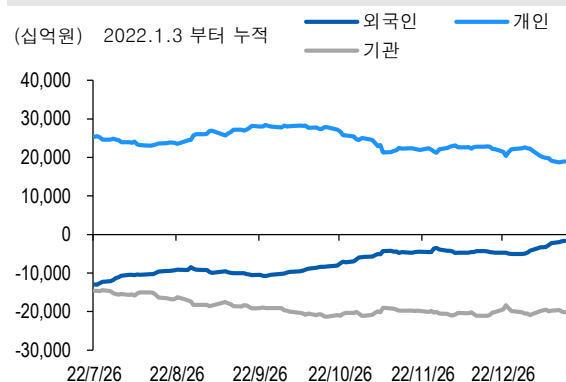
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.58	1.44	1.79	-0.05%
베이스(mini)	0.70	0.72	1.11	0.01%
제1스프레드(SP)	2.12	1.95	1.90	-0.05%
합성선물 베이스(ATM)	0.70	1.13	1.13	0.14%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	72.6	-12.4	60.2	0.0	-16.6	-269.5	31.0	-6.1	-0.4	2.5
개인	148.7	-24.2	124.5	0.0	-0.3	114.3	-10.6	4.0	-0.6	51.4
기관	-215.8	36.3	-179.5	-6.0	-47.8	134.4	-19.8	2.1	1.1	-53.7
금융투자	-66.2	36.0	-30.2	-4.4	-4.5	250.3	-20.2	2.2	1.1	-41.3
투신	-52.7	1.5	-51.2	0.0	-11.9	-85.1	0.3	-0.1	0.0	-13.5
은행+보험+기타금융	-26.5	-11.5	-38.1	0.0	-13.1	-40.0	0.0	0.1	-0.1	1.3
연기금+국가자재	-36.9	5.1	-31.9	0.0	-12.6	9.2	0.0	0.0	0.0	-0.3
기타법인	-5.6	0.4	-5.3	0.0	-0.2	20.8	-0.6	0.0	-0.1	-0.1

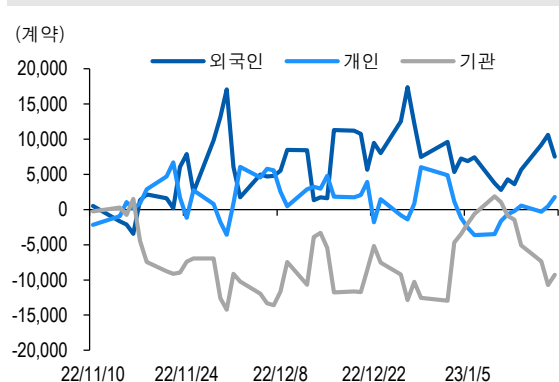
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

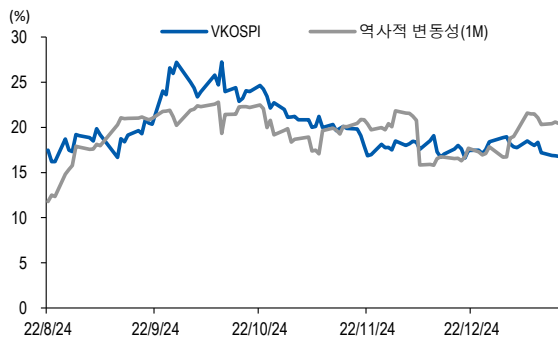


선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향												(계약, 십억원)			
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정	
Call	650,055		171.6		761,302		15.3%		지수옵션 전체	1,239,957		363.8		1,866,386	
Put	589,902		192.1		1,105,084		15.4%			PCR(금액기준)	1.12		VKOSPI		16.80%(−0.05%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	1.41	−0.53	81,521	18,958	3,264	15.2	Put	317.5(K+1)	7.42	0.98	2,194	2,678	141	14.6
	320.0(K+2)	2.05	−0.65	63,438	23,739	5,232	15.4		315.0(K+0)	5.84	0.74	6,217	4,158	−200	14.6
	317.5(K+1)	2.87	−0.82	40,566	10,596	3,117	15.6		312.5(K−1)	4.57	0.63	8,484	9,796	216	14.9
	315.0(K+0)	3.88	−0.95	17,948	12,513	761	15.8		310.0(K−2)	3.52	0.47	18,465	12,709	280	15.2
	312.5(K−1)	5.13	−1.09	12,880	15,404	4,178	16.2		307.5(K−3)	2.66	0.34	31,137	8,436	−195	15.5

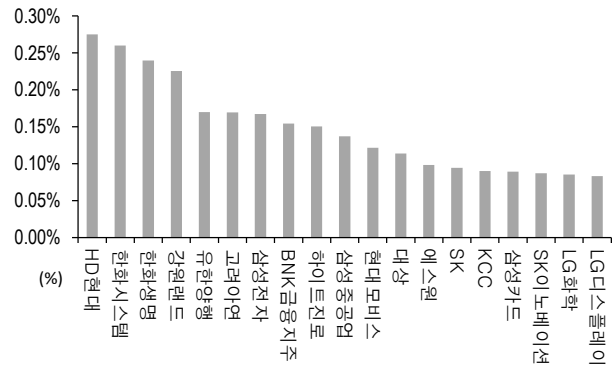
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,145,594	2,002.7	4,139,182	74,615	-18,202	101,734	-84,977	2.5	51.4	-53.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	85,300	-1.16	131.5	103.6	171,469	6,949	0.08%	6,172	8,379	-14,646	-19,273	326
한국금융지주	60,800	-1.14	11.2	98.3	29,323	-599	0.05%	-1,316	5,562	-4,246	-4,047	-199
일진머티리얼즈	59,800	1.01	10.1	89.4	33,571	-118	0.01%	-927	376	551	38	513
삼성전자	60,700	-0.82	596.2	86.0	1,054,936	17,428	0.17%	10,184	20,013	-30,594	-33,779	-3,696
현대건설	36,200	-1.23	19.1	79.5	33,306	-7,850	-0.02%	-4,320	6,476	-2,156	-286	-1,457
현대차	164,500	-1.20	59.8	73.1	32,857	-174	-0.03%	-3,285	2,212	976	395	766
카카오	61,000	-0.97	66.2	65.4	80,483	9,174	-0.19%	9,146	5,794	-15,073	2,754	-614
현대제철	34,400	-1.43	8.4	64.5	16,467	-2,488	-0.04%	-1,829	1,280	506	2,404	-707
NAVER	195,000	0.52	63.6	63.3	26,582	1,446	-0.05%	2,599	-787	-1,711	-1,197	-514
LG 이노텍	284,000	1.07	30.0	62.2	20,014	518	-0.01%	64	92	-156	-481	325

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터