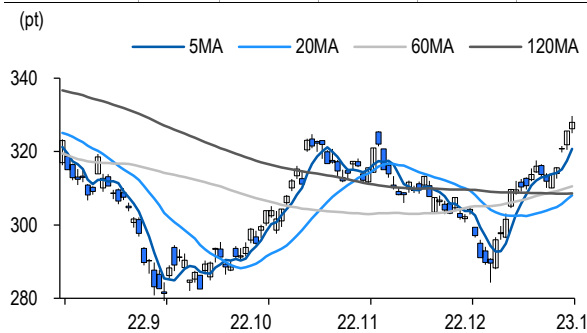


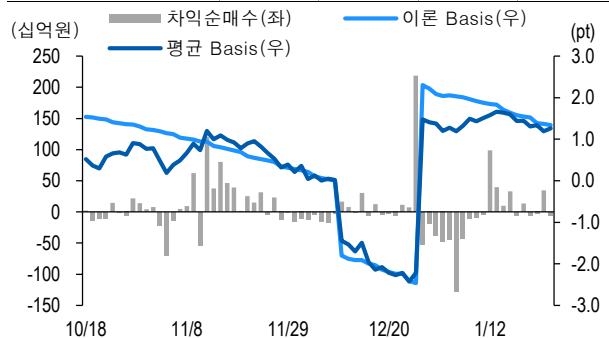
## 선물옵션시장 지표

2023.1.30

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	327.98	0.74	2.41	7,179.3	-
선물 3월물	328.75	0.64	2.10	17,009.5	305,922
선물 6월물	330.95	0.72	2.35	27.9	31,852
2월물(mini)	327.98	0.66	2.16	1,472.3	55,990
3월물(mini)	328.80	0.66	2.40	8.4	2,767



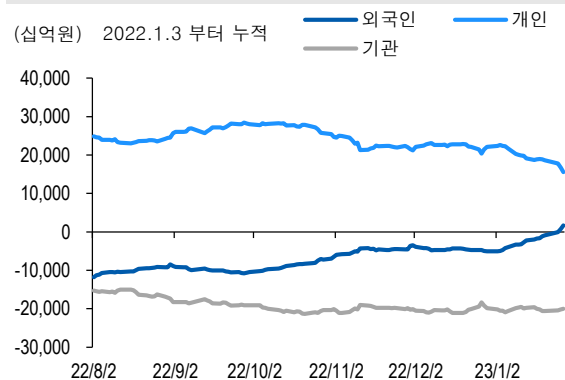
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.34	1.26	0.77	-0.02%
베이스(mini)	0.43	0.46	0.00	0.01%
제1스프레드(SP)	2.16	2.03	2.05	-0.04%
합성선물 베이스(ATM)	0.43	-0.09	-0.09	-0.16%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	969.6	-3.6	966.1	1.5	484.5	205.6	-117.6	-5.9	-3.8	2.3
개인	-1,185.1	32.4	-1,152.7	0.0	2.0	2.6	10.4	8.1	-2.5	-33.9
기관	223.7	-36.6	187.2	-6.8	-70.5	-210.5	106.9	-2.6	6.7	33.4
금융투자	272.5	7.4	279.9	-3.3	0.2	-277.4	107.6	-2.8	5.0	15.5
투신	-3.2	-3.8	-7.0	-3.5	-26.5	32.9	-0.9	0.2	0.1	13.8
은행+보험+기타금융	-12.9	-31.7	-44.6	0.0	-5.4	26.5	0.2	0.0	1.7	0.4
연기금+국가자재	-3.6	-0.9	-4.5	-0.1	-11.2	7.4	0.0	0.0	0.0	3.7
기타법인	-8.2	5.1	-3.1	0.0	0.0	2.3	0.2	0.4	-0.4	-1.8

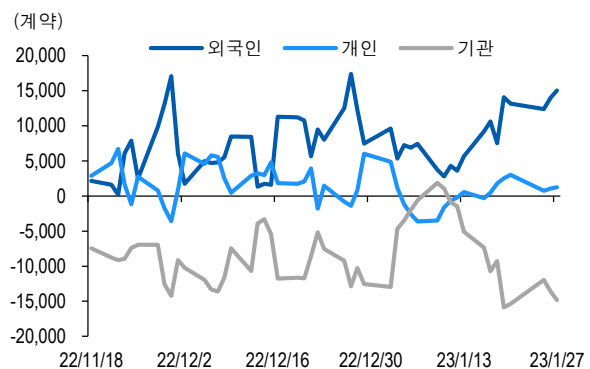
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

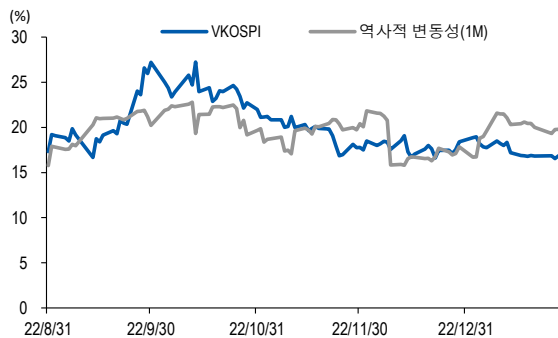
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	990,368	309.1	861,086	14.7%	지수옵션 전체	1,634,781	478.8	2,245,382
Put	644,413	169.7	1,384,296	16.8%	PCR(금액기준)	0.55	VKOSPI	16.86%(+0.33%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	332.5(K+3)	2.13	0.60	68,741	19,012	-861	14.8	Put	327.5(K+1)	3.80	-1.05	16,349	2,987	2,132	16.6
	330.0(K+2)	3.05	0.84	64,158	25,978	-534	14.7		325.0(K+0)	2.76	-0.84	39,047	8,754	5,409	16.7
	327.5(K+1)	4.22	0.99	23,129	19,347	-465	14.6		322.5(K-1)	1.92	-0.68	58,129	10,364	5,482	16.7
	325.0(K+0)	5.65	1.19	14,894	22,313	-907	14.4		320.0(K-2)	1.31	-0.50	68,431	14,496	4,815	16.9
	322.5(K-1)	7.32	1.36	3,318	16,719	-428	14.2		317.5(K-3)	0.88	-0.35	66,203	14,488	4,860	17.1

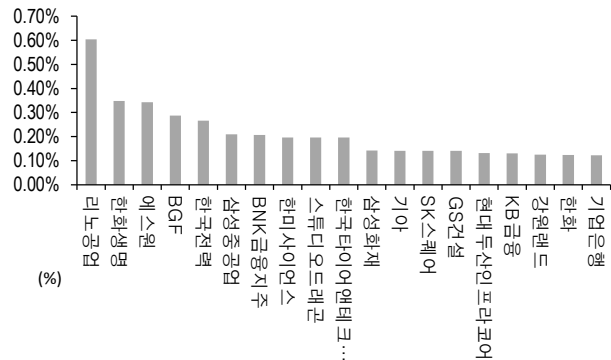
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	3,425,170	2,573.0	4,401,555	83,662	22,605	-30,673	8,880	2.3	-33.9	33.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	91,400	-0.76	162.7	76.1	164,663	1,547	-0.02%	7,305	-927	-6,161	-5,177	-313
아모레퍼시픽	147,400	2.65	27.2	60.6	10,772	-2,225	0.02%	3,300	-662	-2,638	-4,596	-147
카카오	64,600	0.94	100.9	60.5	75,470	7,803	-0.08%	1,880	3,824	-5,434	-6,786	1,252
현대차	174,400	-0.46	121.1	60.0	39,440	-3,859	-0.03%	-1,056	-3,681	4,732	5,017	-369
기아	69,400	-0.29	139.7	56.2	81,686	-6,203	0.14%	-9,016	-6,960	15,673	5,484	2,990
LG 에너지솔루션	504,000	-2.51	130.8	55.8	36,117	4,913	-0.28%	225	-3,364	3,196	3,741	182
포스코케미칼	212,500	1.67	223.9	54.1	41,886	6,044	0.03%	-813	6,630	-5,251	-4,966	-1,015
한국항공우주	48,150	0.31	20.5	53.5	19,844	-652	-0.03%	393	-1,798	1,395	-479	774
삼성전자	64,500	0.62	613.3	52.2	1,080,214	17,912	-0.03%	-8,603	-27,489	35,291	35,825	500
일진머티리얼즈	64,500	1.26	9.4	51.9	36,316	995	0.00%	-467	799	-232	-149	-83

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터