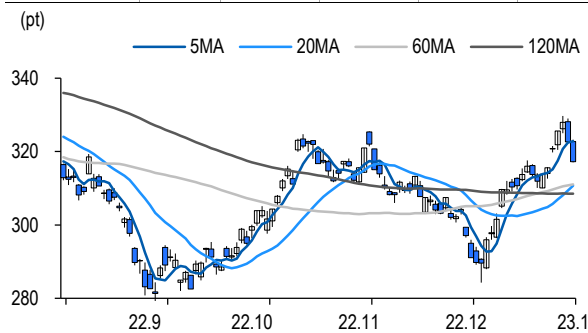


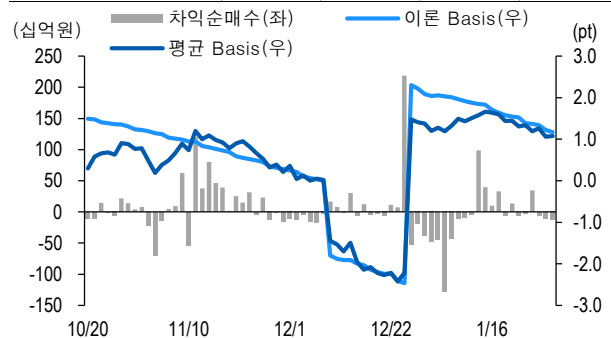
선물옵션시장 지표

2023.2.1

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	317.26	-1.68	-5.41	8,428.0	-
선물 3월물	318.65	-1.61	-5.20	19,104.8	306,901
선물 6월물	320.60	-1.54	-5.00	34.2	34,092
2월물(mini)	317.90	-1.60	-5.18	1,448.4	58,596
3월물(mini)	318.66	-1.61	-5.46	11.3	3,000



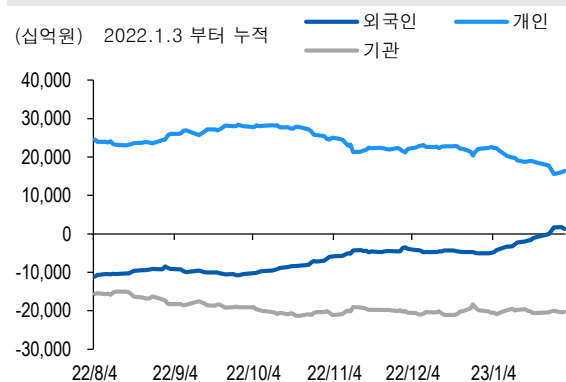
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.17	1.08	1.39	-0.03%
베이스스(mini)	0.28	0.31	0.64	0.01%
제1스프레드(SP)	2.05	1.98	1.90	-0.02%
합성선물 베이스스(ATM)	0.28	0.63	0.63	0.11%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-481.7	-9.2	-491.0	0.5	-92.3	199.2	-86.7	0.0	3.5	21.9
개인	310.6	12.1	322.7	0.0	-2.9	102.1	9.0	-1.7	1.8	19.1
기관	161.3	0.5	161.8	-13.2	-58.0	-295.2	77.9	2.1	-5.7	-40.7
금융투자	275.8	-18.7	257.1	-5.4	4.1	-75.2	78.0	2.3	-5.9	-45.0
투신	-96.7	9.8	-86.8	0.0	-51.6	-185.5	0.0	-0.2	-0.1	5.8
은행+보험+기타금융	-1.9	0.6	-1.4	0.0	-1.0	-39.5	-0.2	0.0	0.3	0.1
연기금+국가자재	2.1	2.2	4.4	0.2	5.0	4.9	0.0	0.0	0.0	-1.6
기타법인	9.8	0.1	9.9	0.0	0.0	-6.0	-0.2	-0.4	0.4	-0.2

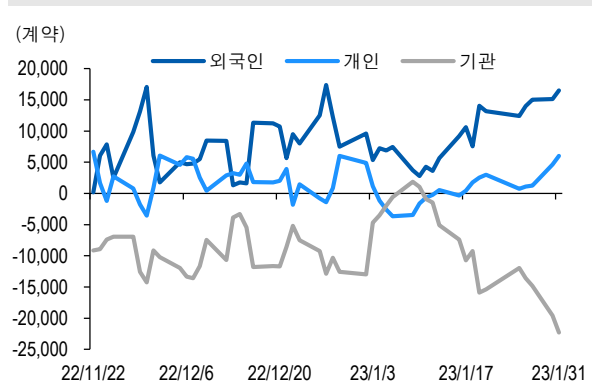
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



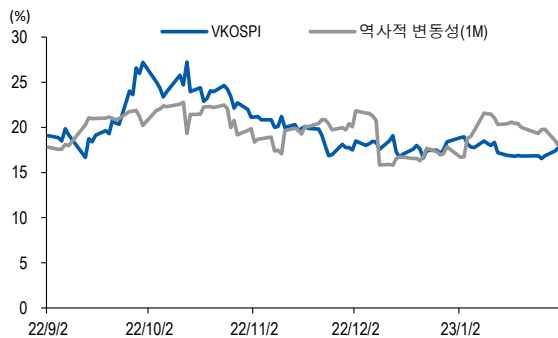
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,070,986	243.1	929,619	17.2%	지수옵션 전체	1,936,234	530.0	2,336,123
Put	865,248	286.8	1,406,504	16.5%	PCR(금액기준)	1.18	VKOSPI	17.75%(+0.37%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	0.38	-0.89	167,083	31,657	1,747	17.2	Put	325.0(K+1)	8.16	3.47	7,414	9,576	-156	14.9
	327.5(K+2)	0.64	-1.32	111,559	22,517	2,815	17.1		322.5(K+0)	6.31	2.91	21,637	9,266	-392	15.5
	325.0(K+1)	1.08	-1.82	95,729	25,572	3,538	17.2		320.0(K-1)	4.73	2.36	66,840	14,418	-856	16.1
	322.5(K+0)	1.70	-2.37	61,290	17,737	1,249	17.3		317.5(K-2)	3.40	1.80	72,564	12,333	-2,336	16.4
	320.0(K-1)	2.65	-2.87	44,378	24,539	319	17.8		315.0(K-3)	2.36	1.32	111,753	17,574	-321	16.8

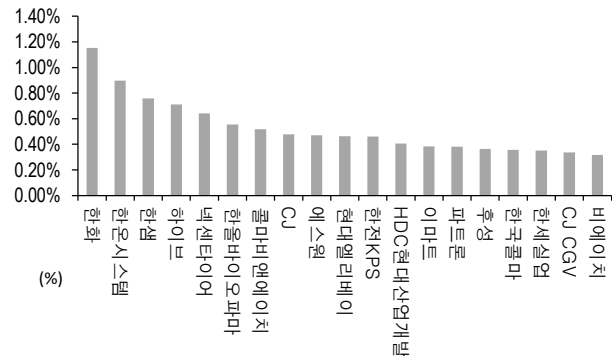
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,841,066	3,345.3	4,517,387	156,984	17,284	40,010	-58,928	21.9	19.1	-40.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	6,700	1.06	0.9	114.1	3,948	307	0.64%	4,474	-36	-4,438	-4,438	0
일진머티리얼즈	62,800	-0.79	11.3	81.8	37,698	190	0.00%	98	389	-407	-625	218
SK 이노베이션	161,700	-1.46	44.9	74.1	12,403	-999	-0.03%	-230	-103	334	-27	31
현대제철	34,150	-2.15	12.9	72.5	23,044	2,897	0.03%	7,614	-3,904	-3,710	-3,897	175
SK 하이닉스	88,600	-2.42	289.4	64.1	168,998	10,145	-0.06%	1,647	6,754	-9,603	-285	-1,612
메리츠증권	6,430	-0.16	6.3	61.3	64,355	3,685	-0.25%	5,790	3,110	-8,900	-5,299	0
삼성전자	61,400	-3.61	1,040.2	59.6	1,187,868	86,684	0.17%	-14,481	21,530	-6,908	-27,019	1,671
NAVER	203,000	-1.93	117.4	53.9	35,427	-2,814	0.05%	-401	-660	1,072	1,068	-138
KT	34,900	-0.99	14.9	53.6	68,747	3,061	0.06%	3,284	795	-4,078	-4,928	850
현대건설	37,900	-1.17	13.5	52.1	25,259	1,664	-0.04%	-1,192	529	748	730	18

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터