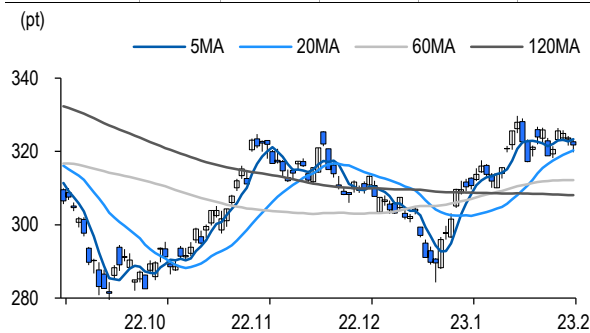


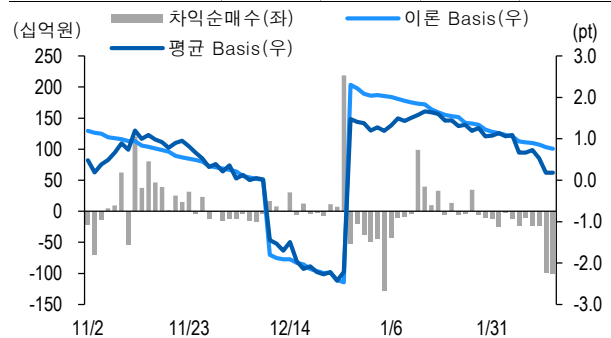
## 선물옵션시장 지표

2023.2.14

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	321.75	-0.60	-1.94	5,567.9	-
선물 3월물	322.60	-0.36	-1.15	19,066.5	301,508
선물 6월물	324.05	-0.52	-1.70	32.8	37,367
3월물(mini)	322.64	-0.35	-1.22	1,479.2	23,006
4월물(mini)	322.48	-0.49	-1.60	6.4	2,055



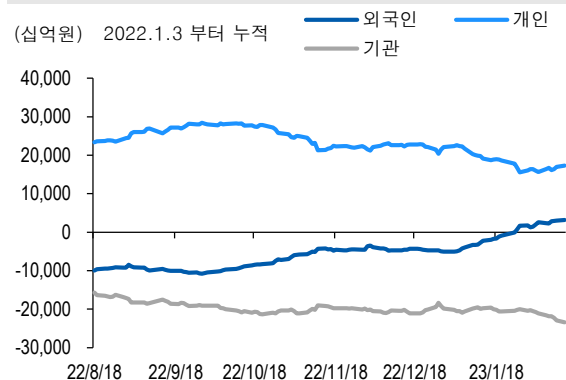
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.74	0.18	0.85	-0.51%
베이스(mini)	0.74	0.18	0.89	-0.17%
제1스프레드(SP)	1.96	1.90	1.90	-0.02%
합성선물 베이스(ATM)	0.74	0.87	0.87	0.04%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	69.3	33.9	103.2	-19.5	-109.1	-106.4	-94.8	-3.1	-0.2	-0.2
개인	341.1	-13.6	327.4	0.0	-1.3	-102.0	4.9	-0.3	0.0	-50.7
기관	-411.8	-48.0	-459.8	-80.8	-60.9	208.0	90.5	3.4	0.2	53.1
금융투자	-234.6	-102.5	-337.1	-71.1	-1.0	273.8	90.8	3.7	0.1	58.3
투신	-91.1	11.2	-79.8	0.0	-40.7	-78.9	0.1	-0.3	0.0	0.5
은행+보험+기타금융	-6.6	11.8	5.2	0.0	-5.6	4.4	-0.4	0.0	0.1	-0.2
연기금+국가지자체	3.5	2.5	6.0	0.0	7.1	8.7	0.0	0.0	0.0	-5.4
기타법인	1.5	23.5	25.0	0.0	0.0	0.4	-0.7	0.0	0.1	-2.2

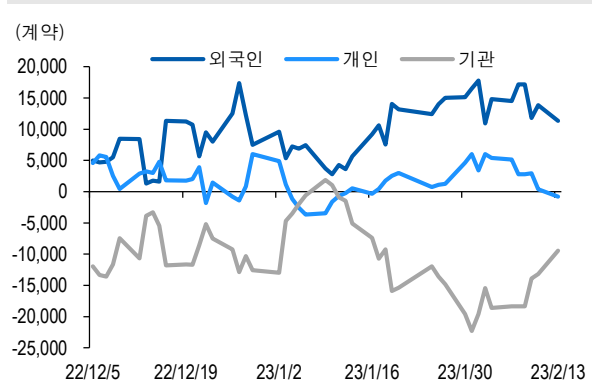
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



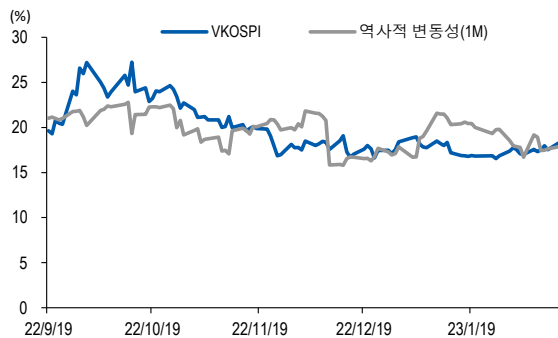
## 선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향										(계약, 십억원)					
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정	
Call	510,204		170.2		682,076		16.5%		지수옵션 전체	1,011,398		377.0		1,720,778	
Put	501,194		206.8		1,038,702		17.4%		PCR(금액기준)	1.21		VKOSPI		18.23%(+0.70%p)	

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	2.63	-0.51	48,152	21,027	2,474	16.4	Put	325.0(K+1)	6.90	0.58	4,769	7,006	290	16.5
	327.5(K+2)	3.49	-0.55	28,057	7,825	2,063	16.6		322.5(K+0)	5.61	0.50	9,168	4,400	814	16.7
	325.0(K+1)	4.50	-0.61	13,863	15,110	1,845	16.8		320.0(K-1)	4.51	0.39	11,051	10,167	326	17.0
	322.5(K+0)	5.73	-0.66	10,121	4,092	947	17.0		317.5(K-2)	3.57	0.31	18,363	7,242	668	17.2
	320.0(K-1)	7.12	-0.77	5,375	12,738	760	17.3		315.0(K-3)	2.80	0.23	40,858	16,195	2,154	17.4

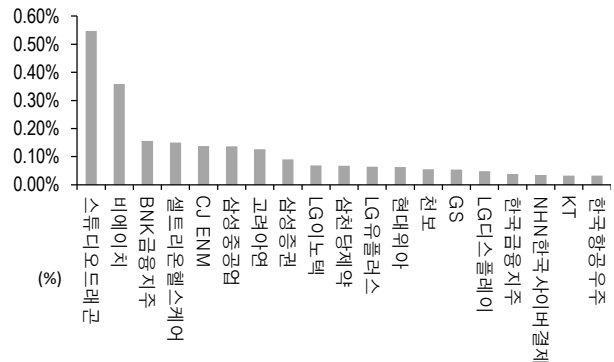
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배울 상위 10종목)											(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	3,269,376	2,333.2	3,746,127	151,367	18,682	-46,229	29,008	-0.2	-50.7	53.1		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배울 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	62,900	0.32	538.0	80.3	1,053,563	1,666	-0.14%	-19,410	-31,856	51,712	56,953	-5,545
현대차	172,700	-0.80	50.9	79.3	31,828	-780	0.00%	357	-1,365	1,007	280	532
메리츠증권	6,650	0.45	3.6	73.5	63,516	-2,706	-0.41%	2,886	-383	-2,503	-2,503	0
일진머티리얼즈	63,600	-1.40	8.8	63.8	43,349	179	0.02%	776	-387	-389	-153	-236
LG 전자	107,500	-2.80	59.9	61.7	46,985	-4,861	0.00%	2,600	-906	-1,720	-1,968	1,044
SK 하이닉스	91,200	-2.36	169.5	60.3	131,088	6,089	0.01%	12,293	8,281	-20,514	-20,338	-2,700
현대제철	33,650	0.30	6.7	57.0	13,442	-1,183	-0.17%	460	1,000	-1,462	2,045	-37
아모레퍼시픽	149,400	-2.54	19.0	56.6	10,342	151	-0.09%	-197	-268	467	502	0
삼성 SDI	721,000	-1.50	87.8	56.2	13,915	-972	-0.07%	250	-993	772	790	155
NAVER	224,000	-2.61	160.7	55.1	35,523	-1,080	-0.12%	-3,148	40	3,685	3,750	-732

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터