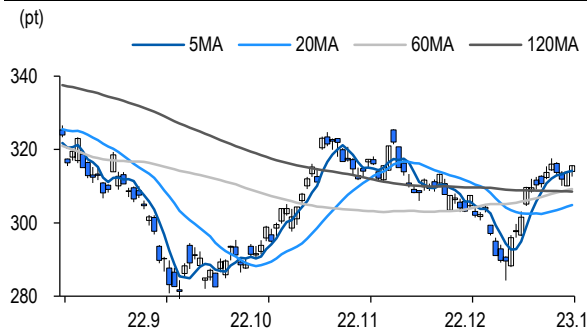


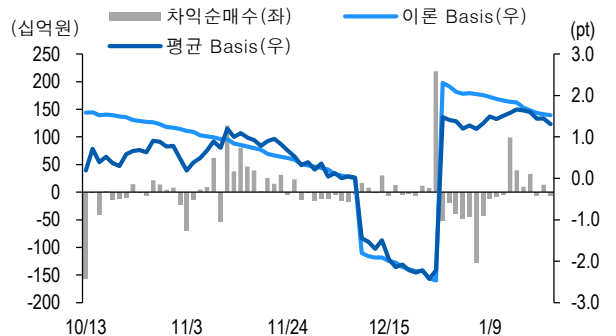
선물옵션시장 지표

2023.1.25

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	315.58	0.56	1.77	3,932.8	-
선물 3월물	316.85	0.67	2.10	16,244.4	313,466
선물 6월물	318.90	0.68	2.15	26.5	27,838
2월물(mini)	316.02	0.66	2.08	1,155.6	44,320
3월물(mini)	316.80	0.65	2.04	3.2	2,227

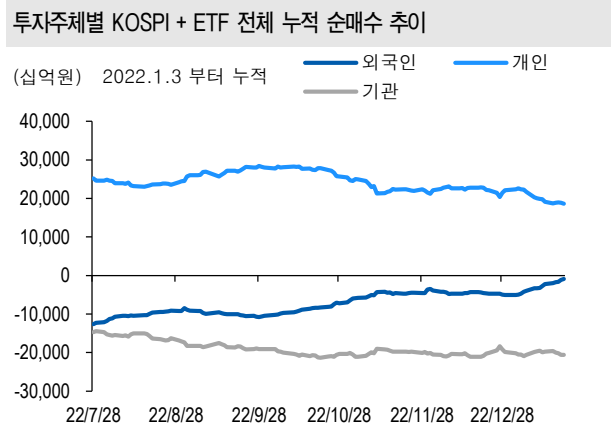


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	1.52	1.31	1.27	-0.07%
베이스스(mini)	0.63	0.58	0.44	-0.02%
제1스프레드(SP)	2.09	1.88	1.90	-0.07%
합성선물 베이스스(ATM)	0.63	0.46	0.46	-0.06%

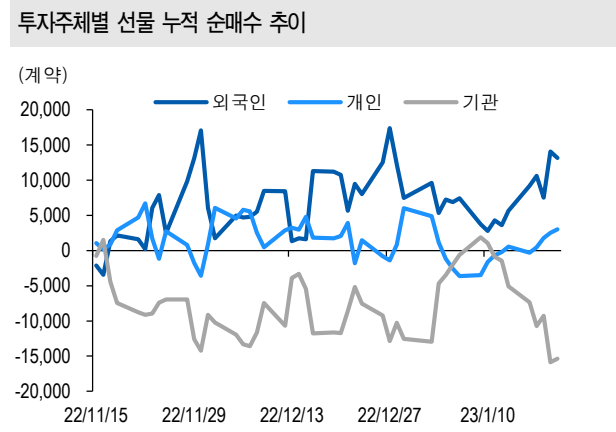


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	230.7	6.4	237.2	3.7	145.8	-46.2	-24.3	-4.3	-0.7	-0.4
개인	-246.2	-2.1	-248.3	0.0	1.1	51.2	-13.6	5.1	0.3	19.5
기관	9.2	-5.2	4.1	-9.4	3.9	-0.2	39.0	-0.7	0.6	-18.8
금융투자	-14.3	-16.5	-30.8	-7.9	1.0	76.5	37.1	-0.6	0.6	-44.4
투신	5.4	-2.9	2.5	0.0	2.9	-119.4	2.0	0.0	0.0	27.7
은행+보험+기타금융	15.1	10.0	25.0	0.0	10.0	46.0	0.0	0.0	0.0	1.1
연기금+국가자자채	-18.7	0.7	-18.0	0.0	-13.0	-3.3	0.0	0.0	0.0	-3.2
기타법인	6.2	0.9	7.1	0.0	-2.0	-4.8	-1.2	-0.1	-0.2	-0.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

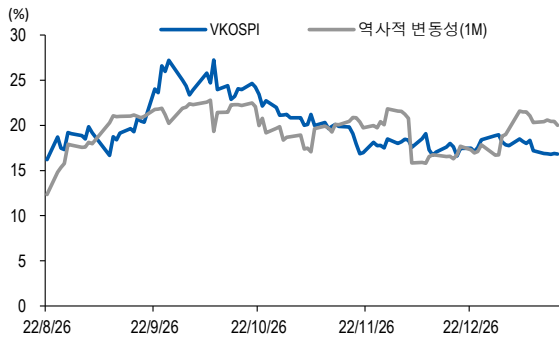
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	626,107	202.4	791,237	14.7%	지수옵션 전체	1,177,742	364.5	1,978,667
Put	551,635	162.1	1,187,430	16.3%	PCR(금액기준)	0.80	VKOSPI	16.81%(-0.08%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	2.07	0.54	82,333	18,933	-2,090	14.8	Put	317.5(K+1)	5.36	-1.32	4,025	3,378	232	15.6
	320.0(K+2)	2.87	0.64	70,290	24,827	446	14.8		315.0(K+0)	4.14	-1.14	9,249	6,967	2,114	15.7
	317.5(K+1)	3.90	0.80	23,148	12,322	273	14.9		312.5(K-1)	3.14	-0.95	14,947	12,324	490	15.9
	315.0(K+0)	5.18	0.94	19,837	14,658	1,922	15.0		310.0(K-2)	2.34	-0.78	36,334	14,497	1,271	16.2
	312.5(K-1)	6.66	1.10	3,733	13,747	-364	15.1		307.5(K-3)	1.71	-0.63	45,448	10,333	54	16.4

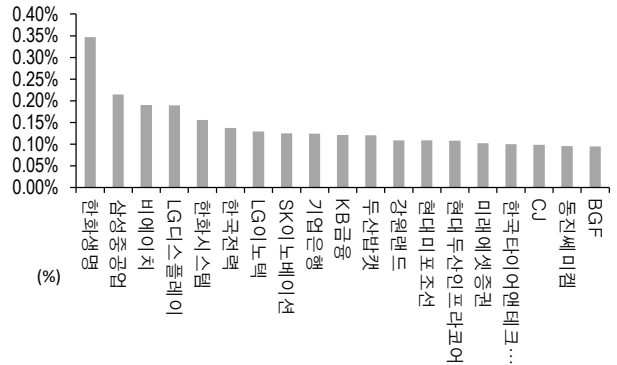
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,364,128	1,573.2	4,226,516	56,255	44,085	48,915	-93,220	-0.4	19.5	-18.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	6,480	0.62	0.6	89.6	4,285	1,921	-0.22%	-2,281	-15	2,296	2,296	0
일진머티리얼즈	59,600	1.71	7.8	73.8	33,070	-431	0.02%	863	-679	-184	-348	164
삼성전자	62,000	0.98	436.2	73.4	1,056,659	9,204	0.06%	-17,160	13,920	4,022	-9,956	-4,100
BGF	4,200	0.96	0.4	70.4	9,809	6,819	0.10%	1,996	4,524	-6,520	-6,520	0
현대제철	35,250	2.62	10.3	65.0	22,078	6,601	0.02%	-831	4,887	-4,133	-3,749	-384
현대위아	52,200	0.38	3.2	62.9	7,025	1,888	-0.08%	1,955	-4,716	2,761	2,635	112
LG 전자	96,600	0.10	22.8	60.7	24,869	2,235	0.04%	2,545	-260	-2,375	-1,021	-1,360
LG 에너지솔루션	470,000	3.30	72.4	58.8	32,671	1,015	-0.32%	-484	-835	1,359	574	10
NAVER	197,500	0.51	90.7	58.4	27,675	1,764	-0.07%	459	2,014	-2,518	-2,558	40
현대차	164,500	0.30	28.0	57.8	33,583	579	-0.02%	-505	1,196	-737	-1,156	503

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터