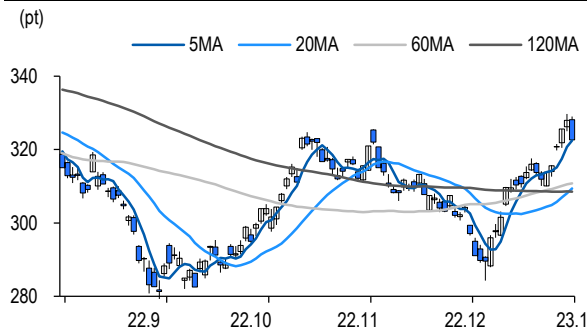


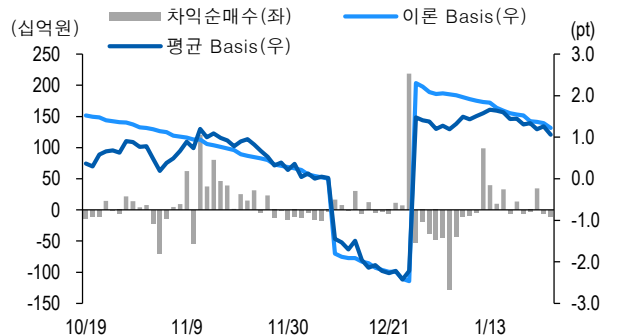
선물옵션시장 지표

2023.1.31

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	322.67	-1.62	-5.31	7,215.8	-
선물 3월물	323.85	-1.49	-4.90	16,973.6	306,598
선물 6월물	325.60	-1.62	-5.35	28.3	33,023
2월물(mini)	323.08	-1.49	-4.90	1,275.8	59,762
3월물(mini)	324.12	-1.41	-4.68	9.1	2,966

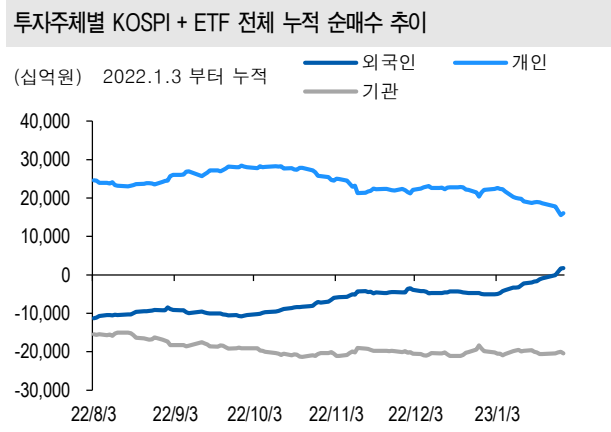


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	1.22	1.06	1.18	-0.05%	
베이스스(mini)	0.32	0.32	0.41	0.00%	
제1스프레드(SP)	2.12	2.01	2.00	-0.03%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.32	0.53	0.53	0.06%	

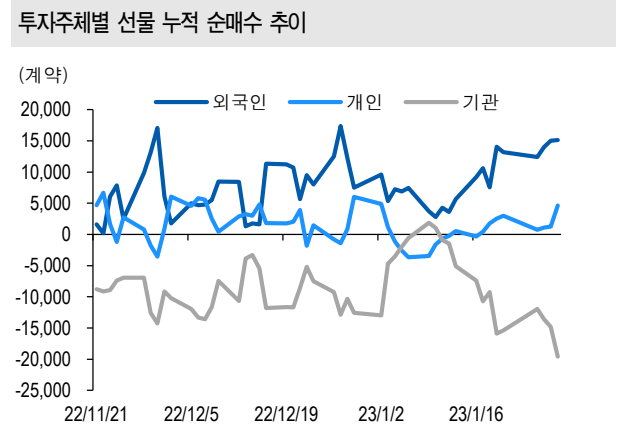


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	17.1	18.8	35.9	0.0	-71.6	-7.2	9.7	-0.7	-1.0	-9.2	
개인	461.8	-8.9	453.0	0.0	0.4	264.0	14.2	0.2	1.4	82.7	
기관	-413.3	-12.6	-425.9	-10.3	-95.1	-360.1	-24.9	0.9	0.3	-73.0	
금융투자	-269.7	18.0	-251.7	-8.7	-12.5	362.1	-24.8	0.7	0.3	-62.9	
투신	-92.5	19.5	-73.0	0.0	-77.1	-710.7	-0.5	0.3	0.1	-13.1	
은행+보험+기타금융	-5.1	-52.0	-57.1	0.0	-9.4	9.1	0.3	0.0	0.0	0.5	
연기금+국가자재	46.4	0.6	46.9	0.1	53.4	-20.7	0.0	0.0	0.0	2.5	
기타법인	-65.7	-8.7	-74.4	0.0	0.0	103.3	1.1	-0.5	-0.7	-0.4	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



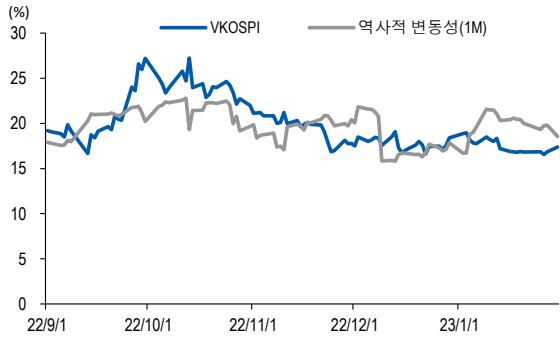
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	999,705	226.5	904,834	16.7%	지수옵션 전체	1,778,834	481.6	2,308,097
Put	779,129	255.1	1,403,263	16.5%	PCR(금액기준)	1.13	VKOSPI	17.38%(+0.52%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	335.0(K+3)	0.47	-0.95	133,181	26,580	4,422	16.6	Put	330.0(K+1)	8.07	2.94	8,221	3,124	771	15.7
	332.5(K+2)	0.79	-1.34	104,149	22,423	3,411	16.7		327.5(K+0)	6.26	2.46	16,252	3,681	694	16.0
	330.0(K+1)	1.27	-1.78	89,528	29,910	3,932	16.7		325.0(K-1)	4.69	1.93	33,777	9,732	978	16.1
	327.5(K+0)	1.96	-2.26	51,329	19,702	355	16.8		322.5(K-2)	3.40	1.48	61,447	9,658	-706	16.4
	325.0(K-1)	2.90	-2.75	24,761	22,034	-279	17.0		320.0(K-3)	2.37	1.06	100,283	15,274	778	16.6

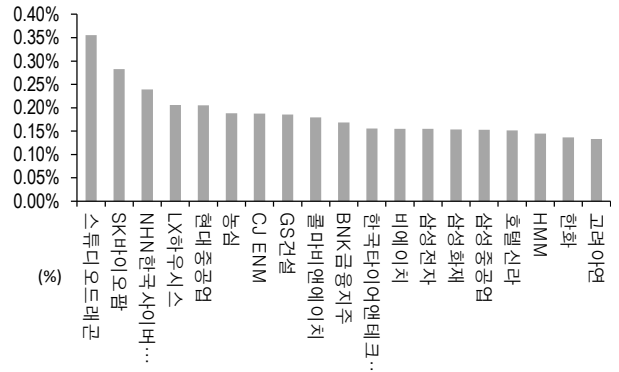
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,581,863	2,673.0	4,360,403	-41,152	-6,824	84,702	-79,248	-9.2	82.7	-73.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	63,300	-1.86	11.2	73.3	37,508	1,192	-0.04%	1,018	274	-1,202	-1,236	27
삼성전자	63,700	-1.24	816.5	66.9	1,101,184	20,970	0.15%	18,860	52,232	-71,051	-66,967	-4,550
SK 하이닉스	90,800	-0.66	138.1	62.5	158,853	-5,810	-0.05%	1,361	524	-1,876	4,962	2,842
한화솔루션	45,500	-2.67	24.8	58.9	50,502	-2,900	-0.14%	-3,185	6,402	-3,227	-632	-5
현대건설	38,350	-1.67	11.9	58.8	23,595	-459	-0.07%	-3,153	532	2,716	2,955	-242
현대제철	34,900	-2.10	8.5	56.8	20,147	952	-0.04%	-1,262	-333	1,619	1,681	-62
카카오	63,500	-1.70	61.8	54.0	69,794	-5,676	-0.04%	-7,910	-1,702	9,597	822	789
SK 이노베이션	164,100	-3.19	28.8	54.0	13,402	-3,728	-0.06%	-1,867	-2,807	4,765	3,634	1,180
신세계	233,000	-1.06	5.3	53.6	2,725	-370	0.09%	368	-25	-483	-446	-37
메리츠증권	6,440	-2.57	6.3	52.6	60,670	-6,279	-0.20%	8,337	2,216	-10,553	-10,753	200

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터