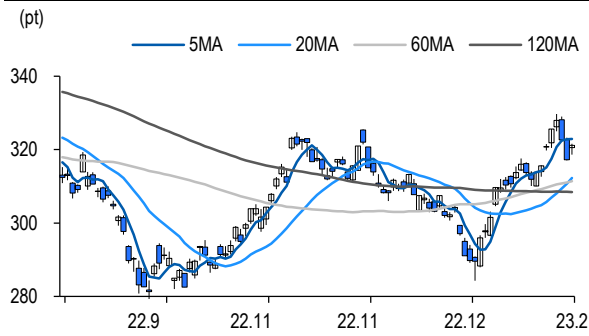


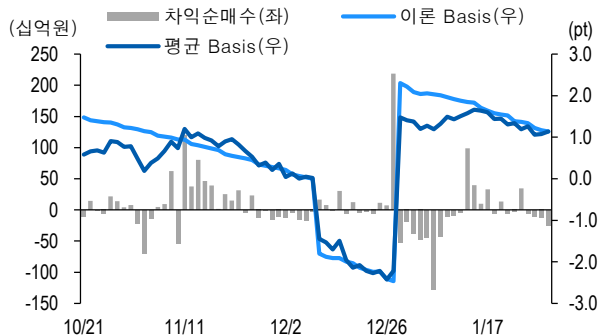
선물옵션시장 지표

2023.2.2

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	321.19	1.24	3.93	6,392.2	-
선물 3월물	322.85	1.32	4.20	17,871.1	309,219
선물 6월물	324.70	1.28	4.10	23.9	34,648
2월물(mini)	322.06	1.31	4.16	1,376.7	59,884
3월물(mini)	322.74	1.28	4.08	10.6	3,194

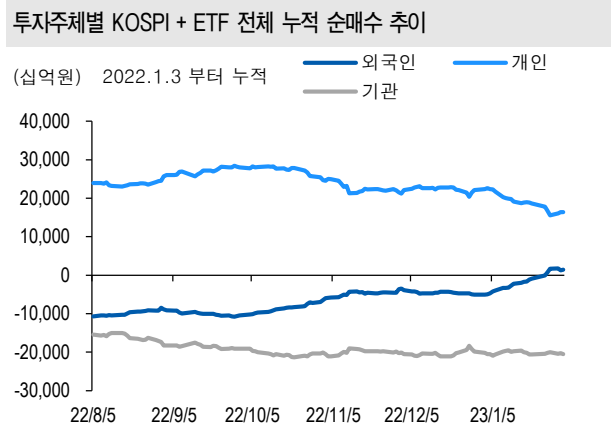


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.14	1.14	1.66	0.00%
베이스(mini)	0.25	0.36	0.87	0.03%
제1스프레드(SP)	2.09	1.90	1.90	-0.06%
합성선물 베이스(ATM)	0.25	0.90	0.90	0.20%

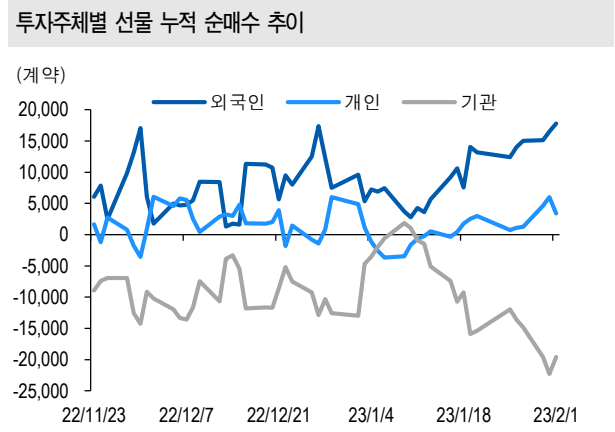


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	198.5	20.1	218.6	0.4	181.2	113.4	-14.3	-4.5	-1.0	-2.1
개인	-18.4	12.6	-5.8	0.0	0.0	-178.9	-32.2	4.6	1.3	9.6
기관	-195.1	-34.5	-229.5	-25.7	-50.1	172.4	47.8	-0.1	0.0	-5.7
금융투자	-52.3	-37.2	-89.5	-19.2	-5.7	-215.4	48.0	0.2	0.3	8.2
투신	-3.5	3.6	0.1	0.0	-24.0	396.6	0.0	-0.3	-0.1	-17.4
은행+보험+기타금융	14.4	-0.3	14.1	0.0	4.4	-6.1	-0.2	0.0	-0.2	-0.3
연기금+국가지자체	-78.4	-0.8	-79.2	1.6	-3.8	-2.7	0.0	0.0	0.0	3.8
기타법인	15.0	-2.0	13.0	0.0	0.3	-106.9	-1.3	0.0	-0.4	-1.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



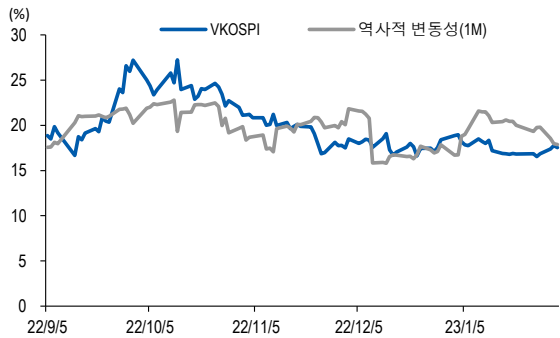
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	834,827	242.8	948,408	18.3%	지수옵션 전체	1,573,570	437.5	2,392,762
Put	738,743	194.7	1,444,354	17.6%	PCR(금액기준)	0.80	VKOSPI	17.54%(-0.21%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	2.18	1.10	112,624	24,545	-1,027	18.2	Put	320.0(K+1)	2.57	-2.16	38,545	15,783	1,365	16.2
	322.5(K+2)	3.25	1.55	84,129	16,575	-1,162	18.6		317.5(K+0)	1.69	-1.71	55,013	12,637	304	16.5
	320.0(K+1)	4.62	1.97	35,091	24,287	-252	19.1		315.0(K-1)	1.12	-1.24	88,909	21,006	3,432	17.2
	317.5(K+0)	6.28	2.48	14,787	14,070	2,042	19.9		312.5(K-2)	0.73	-0.86	105,772	19,917	2,046	17.9
	315.0(K-1)	8.21	2.99	4,847	12,459	340	21.1		310.0(K-3)	0.45	-0.60	114,663	24,401	1,311	18.4

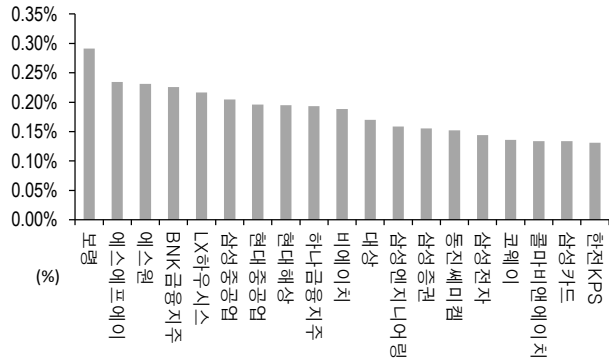
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,805,979	2,656.1	4,588,342	70,955	-7,564	-28,042	38,928	-2.1	9.6	-5.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	64,100	2.07	9.4	88.9	38,025	327	0.06%	-726	1,592	-843	-476	-367
넥센타이어	6,880	2.69	1.0	83.1	3,139	-809	0.12%	-952	-103	1,055	1,055	0
메리츠증권	6,650	3.42	7.4	71.7	62,914	-1,441	-0.27%	-4,733	27	4,706	4,705	0
엔씨소프트	458,500	0.66	24.1	67.8	3,558	-96	0.08%	-121	3	118	109	9
SK 하이닉스	91,100	2.82	227.0	66.6	165,572	-3,426	-0.06%	6,453	-18,661	13,494	4,784	1,024
아모레퍼시픽	141,600	-2.48	53.4	66.3	12,225	2,715	-0.03%	2,287	-1,876	-411	3,837	-379
한화생명	2,725	-0.55	3.9	62.1	62,384	-15,065	0.00%	8,205	-27,828	19,623	19,623	0
삼성전자	61,900	0.81	631.3	59.5	1,205,862	17,994	0.14%	19,329	23,066	-42,766	-47,781	-1,771
NAVER	206,000	1.48	99.4	56.7	36,147	720	0.04%	856	-121	-737	-555	231
LG 화학	693,000	0.29	106.8	56.5	7,376	598	0.00%	-439	348	32	204	-142

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터