

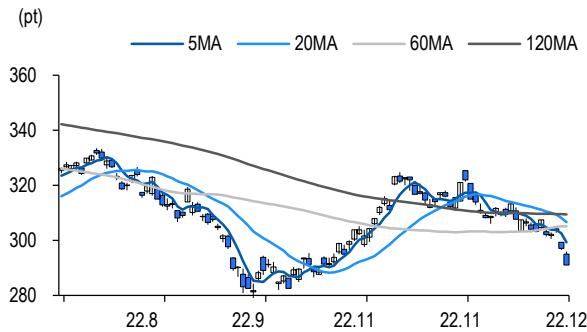


## 선물옵션시장 지표

2023.1.2

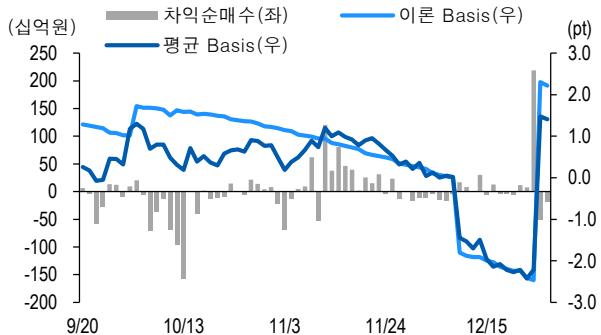
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	291.10	-2.02	-5.99	4,574.7	-
선물 3월물	292.85	-1.88	-5.60	16,818.4	304,599
선물 6월물	294.75	-1.82	-5.45	21.1	24,612
1월물(mini)	291.66	-1.79	-5.32	1,245.8	83,479
2월물(mini)	292.44	-1.70	-5.06	9.1	9,337



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.22	1.41	1.75	-0.28%
베이시스(mini)	0.44	-0.02	0.56	-0.16%
제1스프레드(SP)	2.07	1.88	1.80	-0.06%
합성선물 베이시스(ATM)	0.44	0.42	0.42	-0.01%



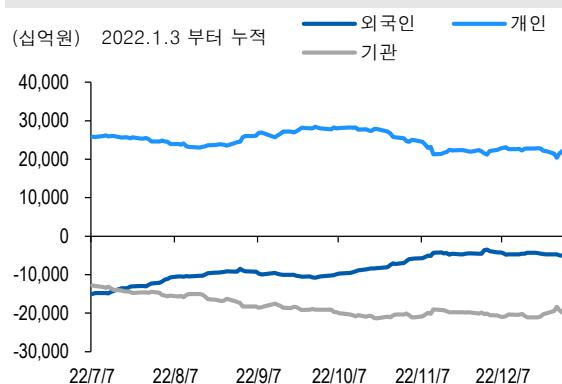
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

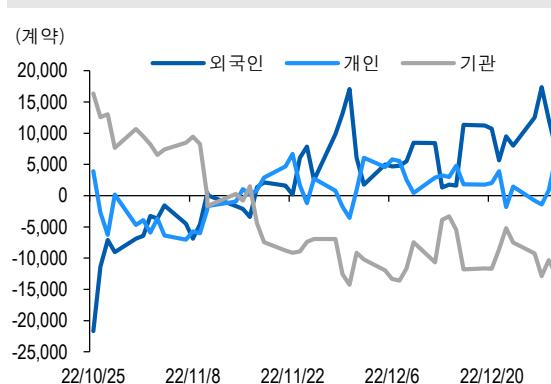
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-140.2	36.0	-104.2	0.8	-135.3	-466.7	115.9	3.7	-7.8	-12.6
개인	671.5	-3.5	668.0	0.0	-0.9	362.6	18.1	-0.9	3.9	5.2
기관	-576.9	-36.9	-613.8	-20.1	-40.1	-31.1	-133.2	-2.6	4.2	5.9
금융투자	-566.2	-45.6	-611.8	-14.2	-8.8	174.8	-136.8	0.9	3.5	14.1
투신	13.7	10.2	23.9	0.0	-10.2	-160.8	0.4	-0.3	0.0	-9.2
은행+보험+기타금융	9.3	-22.3	-13.0	0.0	-9.2	-63.3	3.2	-3.2	0.7	0.5
연기금+국가지자체	-1.0	17.5	16.5	0.0	-8.5	18.2	0.0	0.0	0.0	0.5
기타법인	45.6	4.4	50.0	0.0	-0.3	135.2	-0.7	-0.3	-0.3	1.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	603,318	135.5	895,277	15.8%	지수옵션 전체	1,297,457	376.2	2,202,362
Put	694,139	240.7	1,307,085	16.1%	PCR(금액기준)	1.78	VKOSPI	18.40% (+0.87%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	305.0(K+3)	0.36	-0.59	88,062	24,746	7,500	16.0	Put	300.0(K+1)	9.45	4.05	6,592	17,619	-74	16.2
	302.5(K+2)	0.59	-0.96	87,733	20,704	2,734	15.8		297.5(K+0)	7.48	3.46	8,975	12,880	-901	16.0
	300.0(K+1)	0.95	-1.44	87,596	18,377	4,521	15.7		295.0(K-1)	5.77	2.86	19,179	19,884	-448	16.1
	297.5(K+0)	1.50	-2.00	55,436	11,405	6,906	15.7		292.5(K-2)	4.21	2.14	41,342	15,638	-3,796	15.8
	295.0(K-1)	2.33	-2.55	32,311	9,837	6,500	16.0		290.0(K-3)	3.04	1.61	75,874	19,515	-7,339	16.1

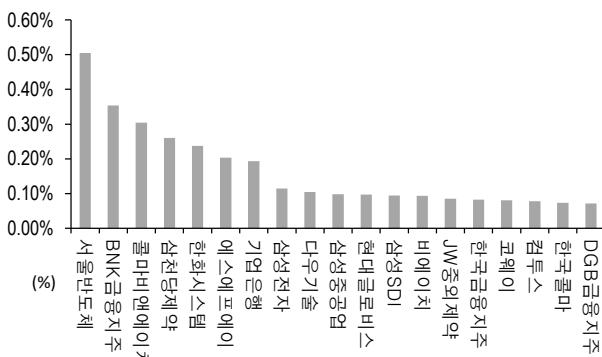
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	2,930,789	1,598.1	4,527,527	-32,634	-67,641	-2,838	69,037	-12.6	5.2	5.9
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	6,060	-4.42	1.8	104.1	3,155	-993	-1.94%	-102	-209	311
일진미티리얼즈	51,700	-0.19	9.0	86.7	31,266	-374	-0.12%	2,157	-2,285	128
한국금융지주	53,700	-2.72	4.4	78.0	25,481	-884	0.08%	-517	299	218
CJ CGV	16,850	-1.75	2.0	76.4	23,918	-1,155	-1.64%	1,104	-1,395	291
한샘	44,150	-2.54	1.4	73.2	1,620	-17	-0.13%	182	-74	-113
SK 하이닉스	75,200	-0.92	81.8	63.8	181,327	2,407	0.01%	-277	6,727	-6,439
아모레퍼시픽	137,000	-2.49	18.8	59.0	12,363	1,073	-0.13%	-476	952	-546
BGF	4,300	0.00	0.4	58.0	2,988	-755	-1.53%	-542	-96	638
엔씨소프트	450,000	3.93	45.5	57.8	3,736	197	-0.03%	-15	-40	45
NAVER	178,000	-1.66	66.1	56.1	25,049	896	-0.04%	-378	-604	982

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터