

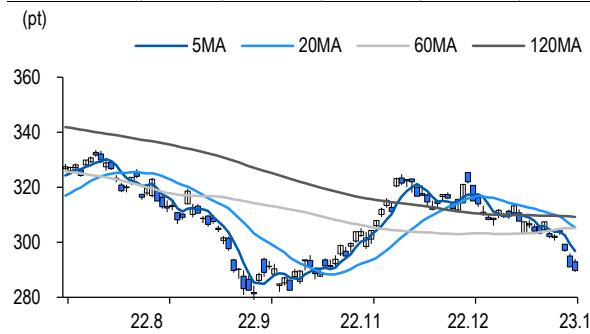


선물옵션시장 지표

2023.1.3

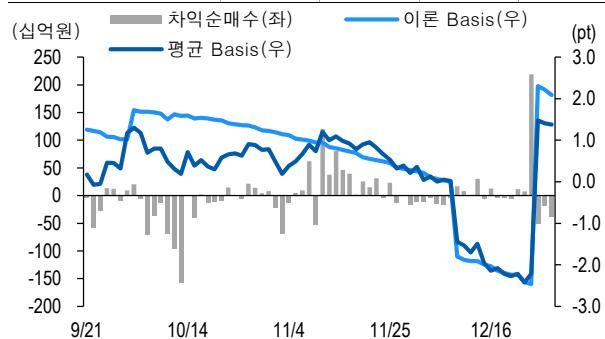
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	326.23	0.46	1.49	4,688.4	-
3월물(big)	323.25	-0.48	-1.55	13,735.7	236,900
6월물(big)	324.05	-0.90	-2.95	11.0	17,908
1월물(mini)	322.54	-0.41	-1.32	956.6	29,902
2월물(mini)	324.26	0.00	0.00	0.0	4



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.09	1.38	1.46	-0.24%
베이시스(mini)	0.32	0.00	0.17	-0.11%
제1스프레드(SP)	2.05	1.83	1.80	-0.08%
합성선물 베이시스(ATM)	0.32	0.10	0.10	-0.07%



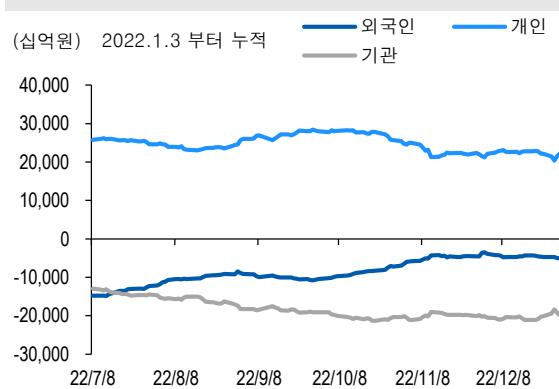
투자주체별 매매 동향

(십억원)

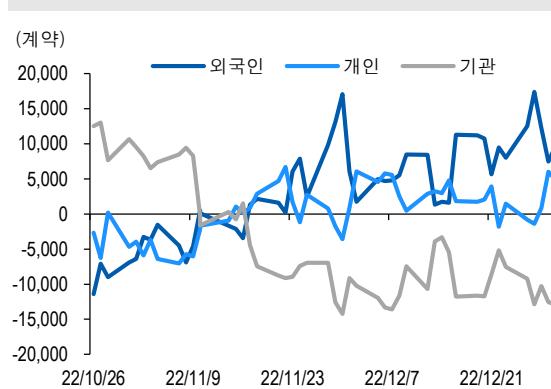
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	6.6	19.9	26.5	1.3	52.4	180.0	-24.2	2.4	-3.0	17.5
개인	223.0	48.3	271.2	0.0	3.5	-87.6	1.9	-0.8	2.5	-16.2
기관	-266.4	-70.3	-336.7	-39.3	-48.9	-50.9	21.9	-1.1	0.1	-1.3
금융투자	-166.7	123.5	-43.2	-21.1	1.2	215.4	22.0	2.2	-0.1	-3.9
투신	13.2	9.7	22.9	0.0	7.4	20.6	0.7	-0.1	0.1	7.5
은행+보험+기타금융	-48.6	-228.8	-277.4	0.0	-20.7	-289.5	-0.8	-3.2	0.0	0.1
연기금+국가지자체	-23.7	3.4	-20.3	0.0	-34.0	2.6	0.0	0.0	0.0	-5.1
기타법인	36.8	2.1	39.0	0.0	0.8	-41.5	0.4	-0.5	0.4	0.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)									
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정	
Call	693,122	120.3	957,922	15.8%	지수옵션 전체		1,259,467	271.1	2,282,902
Put	566,345	150.8	1,324,980	18.1%	PCR(금액기준)		1.25	VKOSPI	18.85% (+0.45%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	297.5(K+3)	0.79	-0.71	77,215	16,082	4,677	15.8	292.5(K+1)	4.81
	295.0(K+2)	1.39	-0.94	52,827	14,878	5,041	16.1	290.0(K+0)	3.45
	292.5(K+1)	2.22	-1.15	23,814	7,480	3,819	16.2	287.5(K-1)	2.44
	290.0(K+0)	3.34	-1.29	9,324	4,733	2,599	16.3	285.0(K-2)	1.50
	287.5(K-1)	4.89	-1.69	1,590	898	513	17.1	282.5(K-3)	1.04
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	292.5(K+1)	4.81	0.60	16,063	15,168	-470	17.4	290.0(K+0)	3.45
	290.0(K+0)	3.45	0.41	36,548	19,503	-12	17.5	287.5(K-1)	2.44
	287.5(K-1)	2.44	0.28	56,574	26,133	1,100	18.0	285.0(K-2)	1.50
	285.0(K-2)	1.50	0.01	76,173	20,789	-738	17.5	282.5(K-3)	1.04
	282.5(K-3)	1.04	0.04	72,687	17,799	-1,940	18.5		

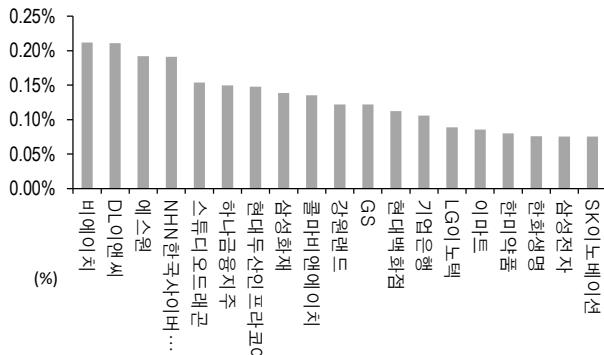
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,943,830	1,627.3	4,569,387	41,860	-25,775	20,132	3,977	17.5	-16.2	-1.3
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
GS	42,700	-2.73	5.7	118.2	24,944	-537	0.12%	-900	125	775
넥센타이어	6,100	0.66	1.8	97.8	5,485	2,330	-0.34%	3,549	-327	-3,222
BGF	4,060	-5.58	0.9	89.3	2,995	7	-0.97%	25	221	-245
삼성생명	70,200	-1.40	8.4	88.2	10,825	-20	-0.14%	427	114	-541
미래에셋증권	5,980	-1.64	2.6	81.6	38,339	1,352	-0.38%	-7,993	-344	8,337
현대제철	30,300	-1.30	6.0	77.8	42,009	-37	-0.04%	-685	-1,352	2,035
엔씨소프트	432,000	-4.00	23.5	77.4	3,635	-101	0.03%	-24	161	-127
일진마티리얼즈	52,000	0.58	6.3	73.0	31,503	237	0.06%	-234	907	-673
SK 하이닉스	75,900	0.93	75.5	72.6	186,786	5,459	0.06%	-1,151	-841	1,996
삼성전기	132,500	1.53	17.0	70.4	15,762	-82	-0.02%	1,234	576	-1,863

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터