

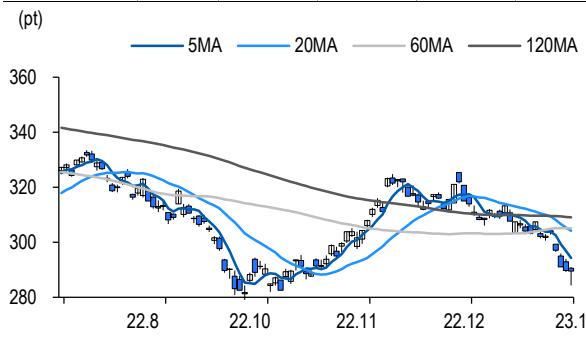


선물옵션시장 지표

2023.1.4

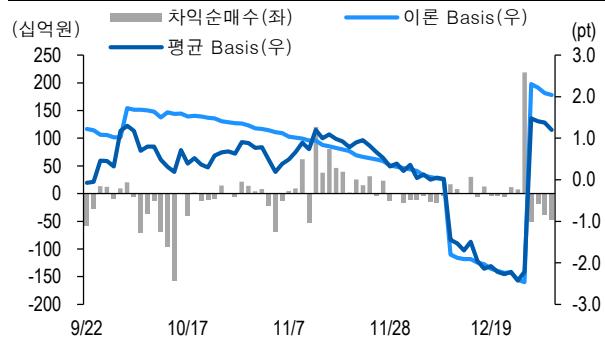
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	289.58	-0.07	-0.21	4,485.7	-
선물 3월물	290.95	-0.10	-0.30	26,965.6	313,578
선물 6월물	292.80	-0.10	-0.30	28.6	24,253
1월물(mini)	289.70	-0.09	-0.26	1,841.4	85,850
2월물(mini)	290.38	-0.07	-0.20	15.2	9,526



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.04	1.20	1.37	-0.29%
베이시스(mini)	0.28	-0.09	0.12	-0.13%
제1스프레드(SP)	2.06	1.76	1.75	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.28	0.16	0.16	-0.04%



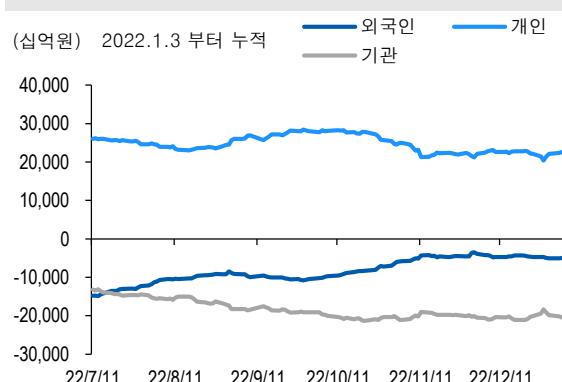
투자주체별 매매 동향

(십억원)

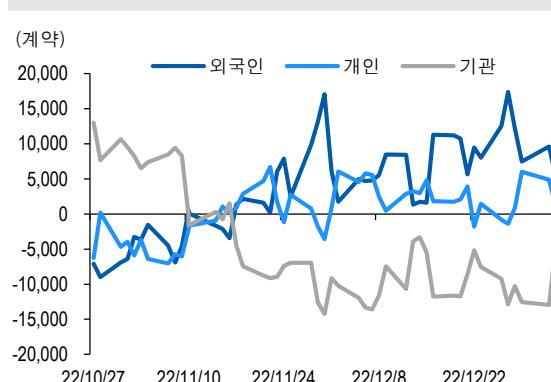
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	51.7	-6.5	45.2	2.2	114.0	-423.5	115.3	-3.7	-1.7	7.5
개인	274.6	-14.7	259.9	0.0	0.7	-234.0	-31.9	5.0	4.2	13.1
기관	-355.8	18.6	-337.1	-50.3	-17.0	680.8	-82.5	-1.1	-2.6	-20.7
금융투자	-353.6	97.6	-256.0	-34.4	0.8	450.4	-81.7	1.8	-2.4	-15.9
투신	-1.8	14.8	13.0	0.0	-8.1	201.5	-0.7	-0.2	-0.1	-14.1
은행+보험+기타금융	18.2	-102.5	-84.3	0.0	5.2	20.8	-0.1	-2.7	-0.1	6.4
연기금+국가지자체	6.5	-40.9	-34.4	-0.1	-16.9	8.1	0.0	0.0	0.0	2.9
기타법인	29.5	2.6	32.1	0.0	0.0	-23.3	-0.8	-0.2	0.1	0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

지수옵션 시장동향

거래량		거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,150,541	262.1	1,012,108	16.5%	지수옵션 전체	2,387,765	635.8	2,383,227
Put	1,237,224	373.7	1,371,119	18.9%	PCR(금액기준)	1.43	VKOSPI	18.96%(+0.11%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	297.5(K+3)	0.71	-0.08	161,093	16,881	799	16.3	Put	292.5(K+1)	4.87	0.06	9,107	15,060	-108	17.8
	295.0(K+2)	1.28	-0.11	183,197	19,158	4,280	16.6		290.0(K+0)	3.47	0.02	30,072	19,003	-500	17.9
	292.5(K+1)	2.10	-0.12	133,007	12,219	4,739	16.8		287.5(K-1)	2.38	-0.06	58,467	23,447	-2,686	18.1
	290.0(K+0)	3.21	-0.13	94,869	13,081	8,348	17.1		285.0(K-2)	1.59	0.09	149,470	20,819	30	18.5
	287.5(K-1)	4.63	-0.26	39,523	6,834	5,936	17.3		282.5(K-3)	1.05	0.01	125,761	23,008	5,209	19.1

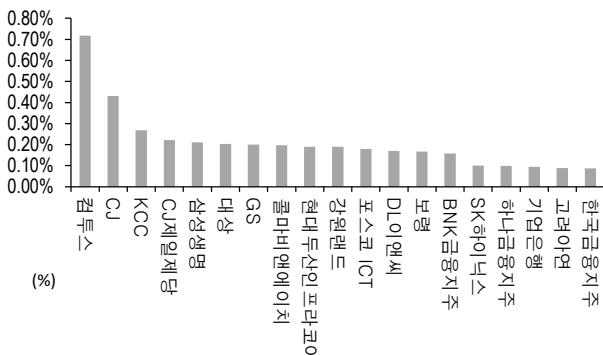
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KBX 유파티클리서치센터

주실선물 평균베이시스 괴리율



자료: KBX 유티즌워리서치센터

주신서물시작 독학(서현배율 삽화 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,845,645	2,166.9	4,620,005	50,618	43,810	54,060	-97,626	7.5	13.1	-20.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균과리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
롯데케미칼	172,000	-1.43	29.3	105.0	28,954	6,232	-0.82%	961	561	-1,522	-752	0
한국금융자주	52,300	0.97	5.8	92.2	20,366	-1,753	0.09%	-208	140	68	-209	277
LG 전자	85,700	-1.04	41.6	91.8	35,627	4,782	-0.14%	2,303	-5,821	3,518	3,110	260
현대차	159,500	1.27	104.8	84.1	47,193	3,637	-0.28%	2,063	-6,086	4,033	4,340	-79
삼성전자	55,500	-0.36	588.3	78.8	1,179,648	24,290	0.05%	1,155	10,066	-11,613	-17,460	-362
한국전력	19,400	0.78	25.8	74.2	144,482	3,336	-0.16%	4,888	-5,990	1,105	9,837	-406
한샘	43,000	0.35	1.2	71.9	1,429	-188	-0.05%	314	-119	-195	-195	0
메리츠증권	5,980	-2.61	5.4	71.9	115,675	-1,279	0.08%	3,589	5,664	-9,253	-9,604	351
SK 하이닉스	75,800	-0.13	142.1	70.0	202,746	15,960	0.10%	3,416	9,961	-13,661	-13,542	978
넥센타이어	6,170	1.15	0.7	69.5	5,180	-305	-0.23%	590	-794	204	204	0

자료: KBX 유파티^{증권} 리서치센터