

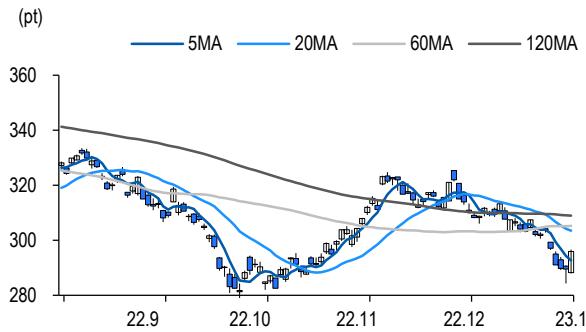


## 선물옵션시장 지표

2023.1.5

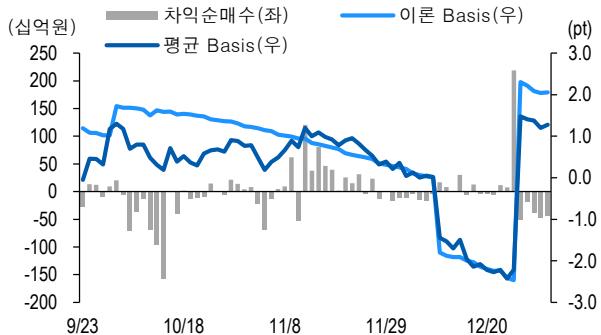
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	295.98	2.21	6.40	5,142.8	-
선물 3월물	297.00	2.08	6.05	25,354.9	307,724
선물 6월물	298.85	2.07	6.05	30.6	24,148
1월물(mini)	295.70	2.07	6.00	1,418.2	88,891
2월물(mini)	296.38	2.07	6.00	19.3	9,637



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.06	1.28	1.02	-0.26%
베이시스(mini)	0.26	-0.05	-0.28	-0.10%
제1스프레드(SP)	2.11	1.72	1.75	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.26	-0.31	-0.31	-0.19%



## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	260.8	-24.0	236.8	4.8	225.4	118.1	16.1	9.3	2.1	-14.5
개인	-296.9	48.9	-248.0	0.0	3.0	-134.0	-35.6	-5.2	-2.0	-14.0
기관	0.7	-22.9	-22.2	-48.8	33.3	65.5	24.2	-5.1	-0.4	28.0
금융투자	-189.6	140.5	-49.1	-30.9	-2.4	-602.6	18.6	-5.4	0.5	6.9
투신	123.2	-10.7	112.5	0.0	60.0	671.6	5.0	-0.1	0.0	19.4
은행+보험+기타금융	6.8	-188.2	-181.4	0.0	7.4	13.9	0.6	0.0	-0.8	0.4
연기금+국가지자체	39.5	-1.5	38.0	-0.3	-15.0	-17.5	0.0	0.4	-0.1	1.3
기타법인	35.4	-2.0	33.4	0.0	0.7	-49.6	-4.7	1.1	0.3	0.5

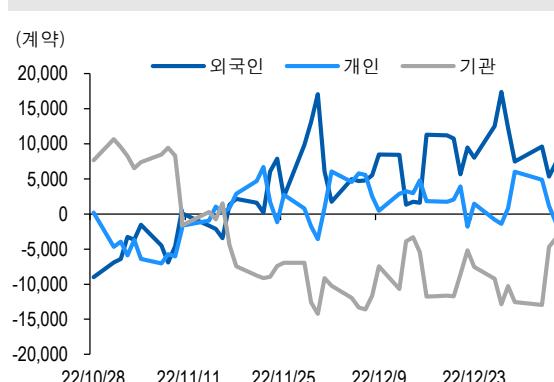
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)															
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	1,133,239	308.9	1,055,685	14.9%	지수옵션 전체	2,120,439	515.1	2,452,343							
Put	987,200	206.2	1,396,658	19.2%	PCR(금액기준)	0.67	VKOSPI	18.17%(-0.79%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	297.5(K+3)	2.23	1.52	150,487	16,542	-339	15.1	Put	292.5(K+1)	1.81	-3.06	48,597	17,707	2,647	18.3
	295.0(K+2)	3.46	2.18	120,254	18,773	-385	15.0		290.0(K+0)	1.15	-2.32	86,931	24,286	5,283	18.6
	292.5(K+1)	4.97	2.87	64,048	12,881	662	14.5		287.5(K-1)	0.68	-1.70	90,621	24,745	1,298	18.7
	290.0(K+0)	6.82	3.61	28,896	12,622	-459	13.9		285.0(K-2)	0.41	-1.18	140,635	23,391	2,572	19.2
	287.5(K-1)	8.88	4.25	7,487	6,712	-122	11.8		282.5(K-3)	0.24	-0.81	120,620	25,751	2,743	19.7

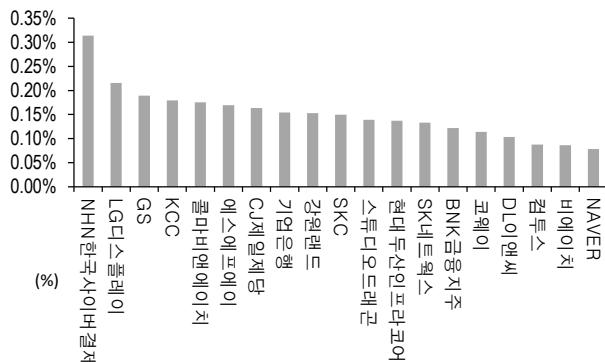
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	4,192,879	2,519.9	4,593,461	-26,544	46,310	-57,714	10,767	-14.5	-14.0	28.0	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
현대차	160,000	0.31	60.0	81.4	47,010	-183	-0.30%	-3,322	585	2,720	2,420
LX 하우시스	31,200	1.96	0.2	80.6	452	72	-0.01%	31	-72	41	41
일진마티리얼즈	53,200	2.70	9.9	78.9	32,643	355	-0.05%	326	-148	-178	-167
삼성전자	57,900	4.32	762.4	66.8	1,090,915	-88,733	-0.06%	-20,220	-21,532	41,948	22,759
LG 화학	604,000	0.17	50.1	65.7	9,971	111	-0.04%	-372	155	217	322
LG 이노텍	266,500	0.57	43.5	65.2	18,326	-843	-0.03%	-109	-391	490	530
현대제철	30,750	1.32	6.9	63.7	41,949	26	0.06%	2,432	-318	-2,113	-1,014
CJ CGV	16,850	-0.59	0.8	63.6	19,688	-1,088	-1.64%	-783	1,174	-391	-391
POSCO 홀딩스	275,000	0.92	37.4	63.0	19,193	-313	-0.03%	-266	175	73	-145
LG 전자	89,600	4.55	32.1	62.6	39,272	3,645	-0.27%	2,090	-5,758	3,669	3,114

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터