

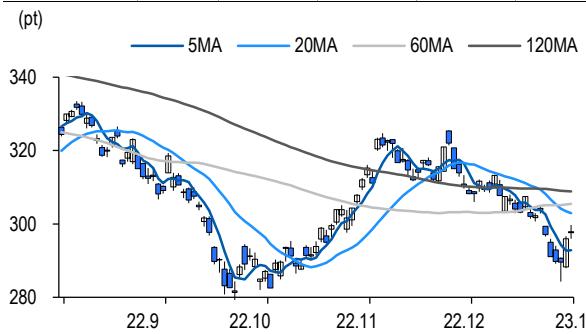


선물옵션시장 지표

2023.1.6

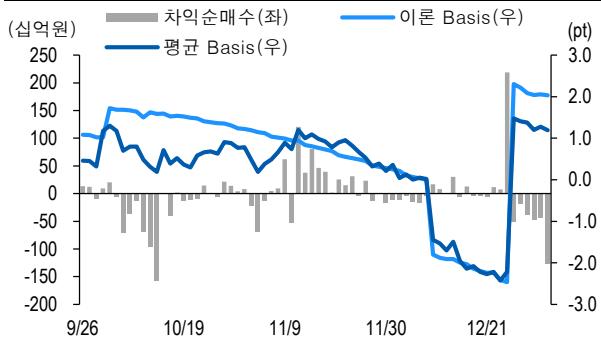
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	297.87	0.64	1.89	5,942.1	-
선물 3월물	298.45	0.49	1.45	25,321.5	308,294
선물 6월물	300.65	0.60	1.80	19.1	24,080
1월물(mini)	297.18	0.50	1.48	1,602.4	84,458
2월물(mini)	298.20	0.61	1.82	16.0	9,757



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.04	1.19	0.58	-0.28%
베이시스(mini)	0.23	-0.09	-0.69	-0.11%
제1스프레드(SP)	2.12	1.75	1.80	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	0.23	-0.58	-0.58	-0.27%



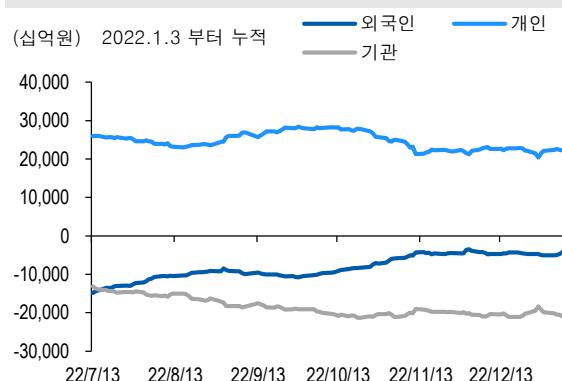
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	509.1	-2.0	507.1	2.3	410.5	-9.6	-17.2	-1.6	2.8	24.6
개인	-164.7	34.8	-130.0	0.0	3.3	-103.6	-0.5	4.7	-1.0	-65.9
기관	-356.6	-29.7	-386.3	-129.9	0.6	97.9	16.5	-3.0	-1.7	42.8
금융투자	-387.2	-104.1	-491.3	-116.5	-0.6	94.5	16.3	-2.8	-1.9	37.3
투신	21.6	-0.9	20.6	0.0	8.1	-11.9	0.0	0.0	-0.1	10.7
은행+보험+기타금융	0.1	55.7	55.8	0.0	-8.7	20.5	0.2	0.0	0.0	1.2
연기금+국가지자체	42.0	0.0	42.0	0.0	16.7	-5.2	0.0	-0.2	0.2	-6.3
기타법인	12.2	-3.1	9.1	0.0	1.3	15.3	1.2	-0.1	-0.1	-1.5

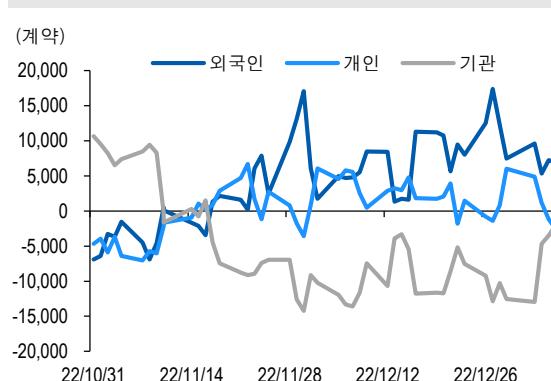
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,162,891	270.3	1,100,133	14.0%	지수옵션 전체	2,203,888	488.7	2,577,428							
Put	1,040,997	218.4	1,477,295	18.4%	PCR(금액기준)	0.81	VKOSPI	17.85%(-0.32%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	302.5(K+3)	0.91	0.15	205,624	28,650	861	14.2	Put	297.5(K+1)	2.93	-1.11	51,413	18,488	5,497	18.4
	300.0(K+2)	1.66	0.31	173,134	31,131	73	14.1		295.0(K+0)	1.84	-0.93	120,826	20,542	2,236	18.1
	297.5(K+1)	2.71	0.48	51,799	17,871	1,329	13.6		292.5(K-1)	1.14	-0.67	150,526	21,442	3,735	18.3
	295.0(K+0)	4.13	0.67	17,883	17,614	-1,159	12.7		290.0(K-2)	0.64	-0.51	170,767	30,376	6,090	18.3
	292.5(K-1)	5.93	0.96	4,078	12,269	-612	11.2		287.5(K-3)	0.35	-0.33	120,581	32,659	7,914	18.6

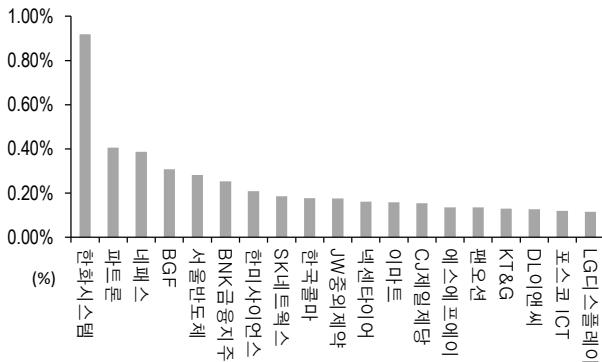
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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	4,034,951	2,402.6	4,689,172	95,711	129,824	-163,143	36,151	24.6	-65.9	42.8
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
일진머티리얼즈	52,500	-1.32	10.3	102.4	32,500	-143	0.01%	-544	998	-454
현대차	159,000	-0.63	81.6	89.1	41,696	-5,314	0.11%	-222	7,481	-7,265
SK 하이닉스	81,700	0.49	214.7	77.6	205,295	5,588	0.04%	-5,849	2,506	3,819
LG 전자	90,000	0.45	24.7	74.3	40,172	900	-0.14%	16	311	-387
삼성전자	58,300	0.69	613.3	67.4	1,060,151	-30,764	0.03%	-8,635	-79,808	88,744
POSCO 홀딩스	278,500	1.27	57.7	63.5	19,379	186	-0.01%	415	178	-613
현대제철	31,750	3.25	8.5	63.4	39,348	-2,601	0.07%	1,177	-2,953	1,784
한울바이오파마	17,450	-1.13	1.3	62.2	5,944	315	-0.23%	-269	218	51
LG 이노텍	265,000	-0.56	25.9	60.7	17,854	-472	0.01%	-149	-40	189
한국전력	19,650	0.26	17.1	55.7	135,237	-10,106	-0.17%	1,078	2,693	-3,298

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터