

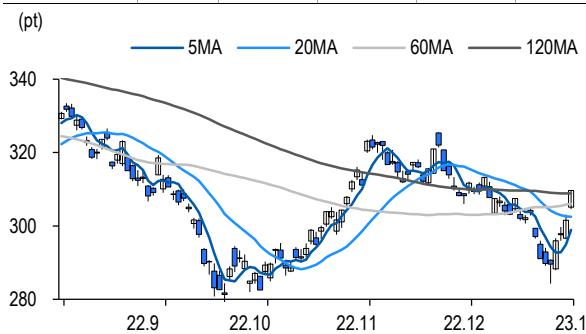


선물옵션시장 지표

2023.1.10

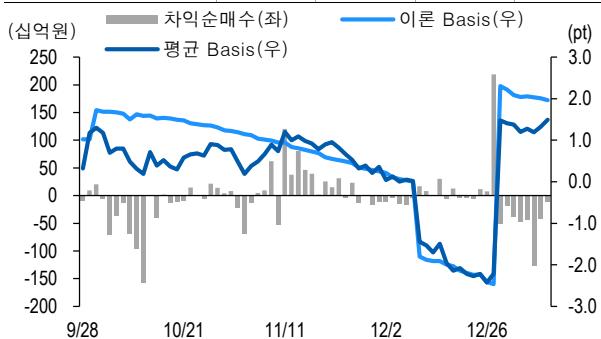
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	309.69	2.71	8.16	5,781.0	-
선물 3월물	311.50	2.72	8.25	26,467.9	305,275
선물 6월물	313.25	2.76	8.40	34.7	24,229
1월물(mini)	310.14	2.75	8.30	1,651.6	84,266
2월물(mini)	310.78	2.79	8.44	37.6	10,196



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.96	1.49	1.81	-0.15%
베이시스(mini)	0.10	0.12	0.45	0.01%
제1스프레드(SP)	2.23	1.83	1.95	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	0.35	0.35	0.08%



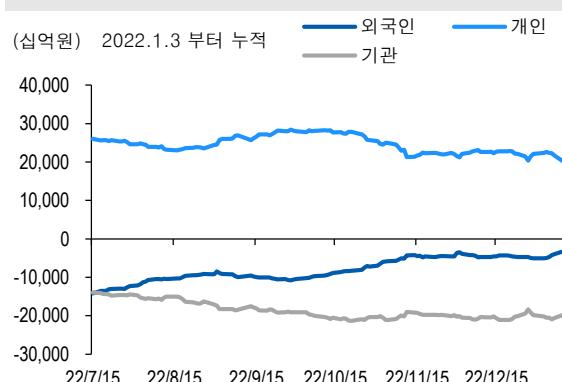
투자주체별 매매 동향

(십억원)

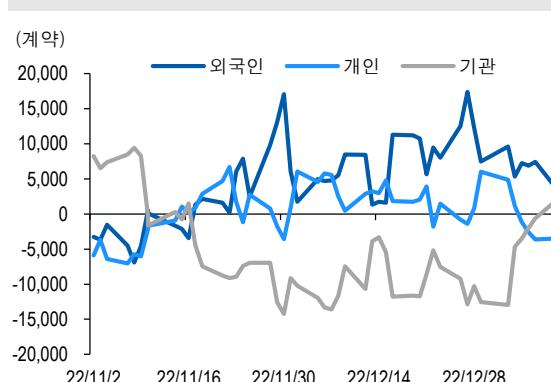
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	652.8	-34.1	618.7	6.2	385.8	-245.4	-44.8	-10.1	1.5	23.0
개인	-1,395.3	24.4	-1,370.8	0.0	2.4	14.1	-1.1	14.5	-3.2	9.1
기관	740.9	68.1	809.0	-16.9	93.1	152.7	43.1	-6.2	4.4	-35.1
금융투자	389.8	47.7	437.5	-16.7	7.3	-314.2	45.4	-6.7	4.1	-81.1
투신	86.5	6.3	92.8	0.0	8.6	359.2	-2.1	0.6	-0.4	50.1
은행+보험+기타금융	152.7	16.9	169.5	0.0	88.9	108.2	-0.3	-0.1	0.7	0.2
연기금+국가지자체	47.3	-3.9	43.5	-0.2	-7.5	-0.6	0.0	0.0	0.0	-4.3
기타법인	1.5	-58.4	-56.9	0.0	0.5	78.7	2.8	1.8	-2.7	3.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,979,169	658.7	1,183,862	20.5%	지수옵션 전체	4,868,609	1,020.8	2,848,075
Put	1,889,440	362.1	1,664,213	22.2%	PCR(금액기준)	0.55	VKOSPI	18.48% (+0.74%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	310.0(K+3)	2.53	2.23	427,169	43,126	-19,528	20.2	305.0(K+1)
	307.5(K+2)	4.03	3.30	222,841	29,014	-6,812	21.0	302.5(K+0)
	305.0(K+1)	5.91	4.52	66,682	27,304	-4,488	22.4	300.0(K-1)
	302.5(K+0)	8.03	5.65	25,277	25,508	-3,060	24.1	297.5(K-2)
	300.0(K-1)	10.30	6.55	8,618	27,547	-1,286	26.0	295.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	305.0(K+1)	0.85	-2.99	239,004	29,660	19,156	20.1	302.5(K+0)
	302.5(K+0)	0.49	-2.54	310,697	28,552	14,761	21.2	300.0(K-1)
	300.0(K-1)	0.30	-1.63	339,716	33,524	11,235	22.9	297.5(K-2)
	297.5(K-2)	0.19	-0.91	220,848	32,985	9,195	24.5	295.0(K-3)
	295.0(K-3)	0.11	-0.50	124,637	35,795	6,555	25.7	

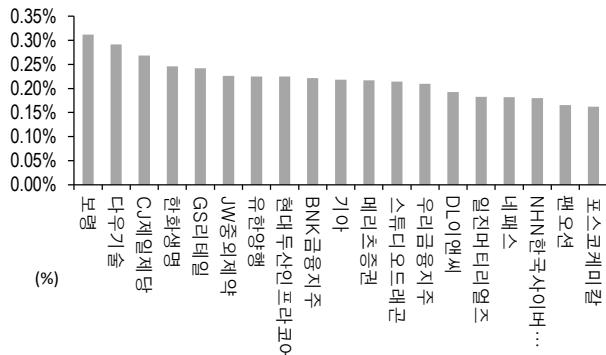
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)
주식선물 전체	3,996,286	2,717.8	4,824,627	96,809	48,602	15,050	-66,120	23.0	9.1	-35.1
<hr/>										
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	165,000	3.13	82.8	82.7	37,994	-1,552	0.16%	6,333	679	-6,993
LG 전자	95,200	5.43	85.7	72.9	27,034	-14,388	0.07%	-4,163	12,765	-9,748
일진미티리얼즈	55,600	1.83	6.6	64.0	30,887	-964	0.18%	-626	1,683	-1,057
삼성전자	60,600	2.89	669.0	59.7	900,149	-170,039	-0.03%	21,793	-22,257	57
포스코케미칼	191,500	1.86	53.0	58.7	24,000	-1,375	0.16%	-577	-201	768
SK 하이닉스	86,100	3.36	187.8	55.9	211,391	526	-0.02%	-7,811	-6,958	14,122
호텔신라	85,700	0.94	17.2	54.2	19,116	-2,641	0.03%	313	2,684	-3,091
롯데케미칼	185,500	5.10	24.3	53.9	22,898	-2,227	-0.28%	-504	-110	614
POSCO 홀딩스	289,000	1.23	40.5	52.6	18,081	-1,185	0.03%	-826	157	669
CJ CGV	17,700	3.51	1.8	51.8	13,038	-5,053	-0.02%	1,914	-1,247	-667

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터