

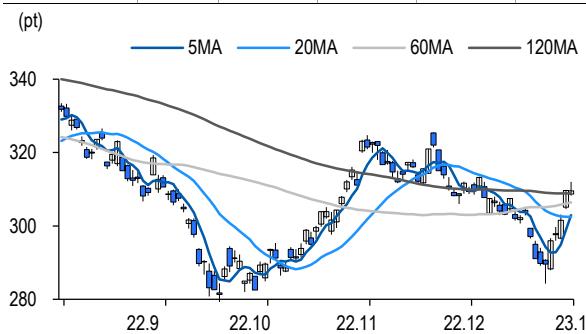


선물옵션시장 지표

2023.1.11

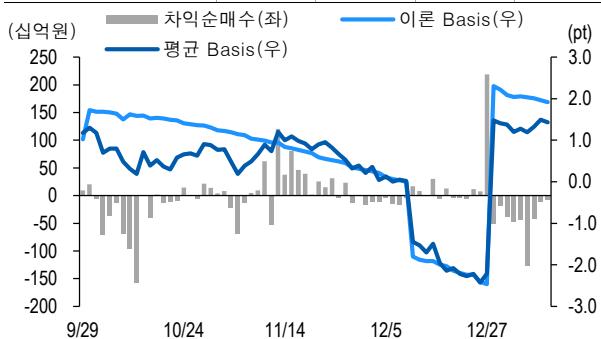
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	309.57	-0.04	-0.12	5,273.5	-
선물 3월물	310.90	-0.19	-0.60	24,123.3	302,764
선물 6월물	313.00	-0.08	-0.25	28.3	24,303
1월물(mini)	309.52	-0.20	-0.62	1,830.0	90,343
2월물(mini)	310.24	-0.17	-0.54	49.7	10,606



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.92	1.43	1.33	-0.16%
베이시스(mini)	0.07	0.09	-0.05	0.01%
제1스프레드(SP)	2.21	1.91	1.90	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.07	-0.03	-0.03	-0.03%



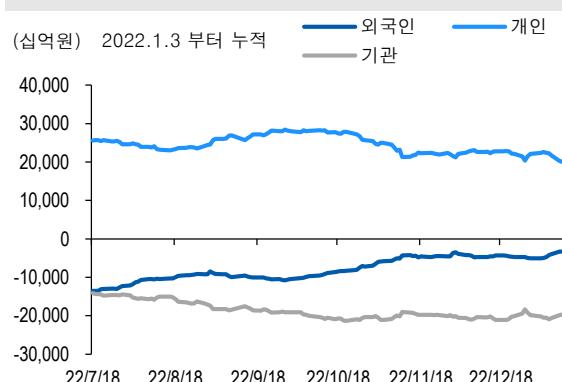
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-2.2	18.5	16.3	-0.5	-91.5	-94.9	22.8	-6.5	2.2	-16.5
개인	-298.8	75.4	-223.4	0.0	2.8	164.5	-21.1	11.6	-4.6	-40.5
기관	296.9	-150.9	146.0	-8.2	45.4	-65.3	0.5	-4.9	3.7	59.6
금융투자	226.6	-136.0	90.7	-0.1	0.3	180.2	2.5	-5.1	3.6	58.7
투신	36.6	-10.2	26.4	-3.5	29.8	-298.1	-2.7	0.4	0.0	-2.3
은행+보험+기타금융	28.8	-14.5	14.3	0.0	16.7	24.6	0.7	0.0	0.0	0.4
연기금+국가지자체	1.7	-2.4	-0.7	0.0	8.2	28.0	0.0	-0.2	0.1	2.9
기타법인	4.1	57.0	61.1	0.0	-1.3	-4.3	-2.2	-0.2	-1.3	-2.6

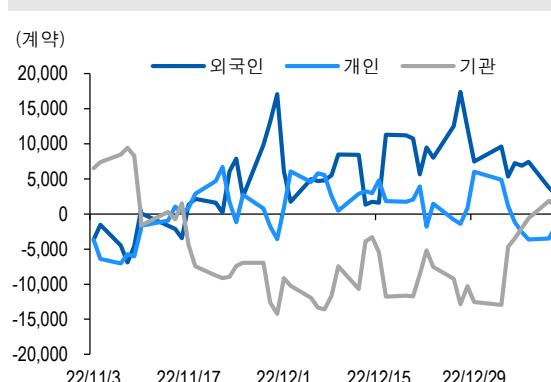
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,692,265	541.5	1,176,521	18.2%	지수옵션 전체	4,540,323	925.8	2,884,735							
Put	1,848,058	384.3	1,708,214	19.4%	PCR(금액기준)	0.71	VKOSPI	18.22%(-0.26%)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	0.19	-0.19	411,760	33,241	-5,982	19.3	Put	312.5(K+1)	3.82	-0.08	39,972	6,081	1,820	18.8
	315.0(K+2)	0.38	-0.37	502,331	42,691	98	17.9		310.0(K+0)	2.22	-0.33	189,046	16,194	5,318	18.3
	312.5(K+1)	0.82	-0.67	419,040	33,455	-3,967	17.0		307.5(K-1)	1.16	-0.35	329,084	22,068	4,603	18.5
	310.0(K+0)	1.76	-0.77	227,500	37,421	-5,705	17.1		305.0(K-2)	0.56	-0.29	407,641	33,643	3,983	19.1
	307.5(K-1)	3.20	-0.83	71,052	28,459	-555	17.2		302.5(K-3)	0.26	-0.23	284,587	32,859	4,307	20.1

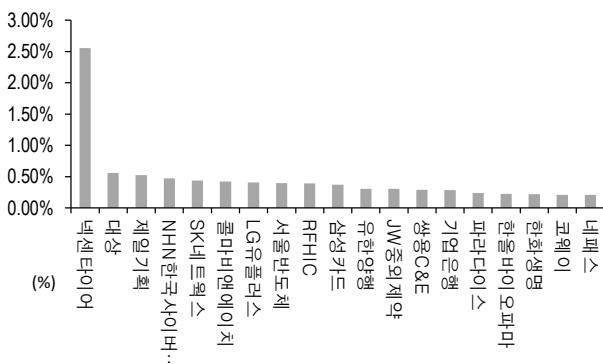
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KBX 유통기획 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KBX 유판타운 콘텐츠

증시서물시장 동향(서현배율 산정 10주목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	4,330,900	3,012.8	4,910,722	86,095	18,887	-22,781	5,768	-16.5	-40.5	59.6		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리를 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 전자	95,300	0.11	50.2	91.2	19,432	-7,602	0.04%	-3,677	6,427	-3,034	-2,690	-894
현대차	163,000	-1.21	58.5	87.7	32,092	-5,902	0.03%	-2,543	1,137	1,967	1,635	285
아모레퍼시픽	140,500	-3.10	33.4	74.1	13,176	1,146	-0.04%	-2,283	-233	2,516	2,925	4
일진머티리얼즈	56,500	1.62	10.0	69.5	30,371	-516	0.20%	1,548	1,380	-2,931	-2,900	-31
삼성전자	60,600	0.00	608.9	68.9	599,874	-300,275	0.04%	-8,617	-14,152	24,240	24,688	-2,199
한국금융지주	59,400	0.34	4.7	65.6	12,132	-3,288	0.07%	228	-41	-187	-717	19
SK 하이닉스	86,500	0.46	171.7	64.4	180,916	-30,475	-0.05%	2,604	-11,245	7,988	8,622	-361
호텔신라	83,500	-2.57	27.5	63.3	18,637	-479	-0.02%	529	-1,052	523	331	76
LG 화학	628,000	0.64	85.5	62.4	7,343	-3,131	0.02%	527	-1,782	1,225	724	501
엔씨소프트	453,000	2.84	23.3	61.3	2,654	-1,199	-0.01%	206	-112	-91	-224	133

자료: KBX 유통기획 리서치센터