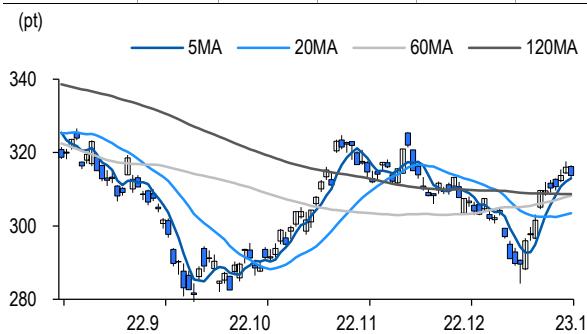


선물옵션시장 지표

2023.1.18

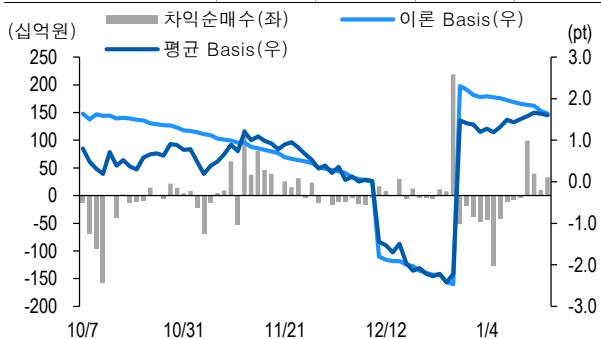
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.75	-0.72	-2.29	4,748.5	-
선물 3월물	315.55	-0.68	-2.15	18,952.0	305,719
선물 6월물	317.25	-0.78	-2.50	26.5	26,627
2월물(mini)	314.76	-0.68	-2.14	1,240.7	39,384
3월물(mini)	315.30	-0.76	-2.30	3.7	2,154



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.64	1.60	1.80	-0.01%
베이시스(mini)	0.74	0.81	1.01	0.02%
제1스프레드(SP)	2.15	2.00	2.00	-0.05%
합성선물 베이시스(ATM)	0.74	0.98	0.98	0.08%



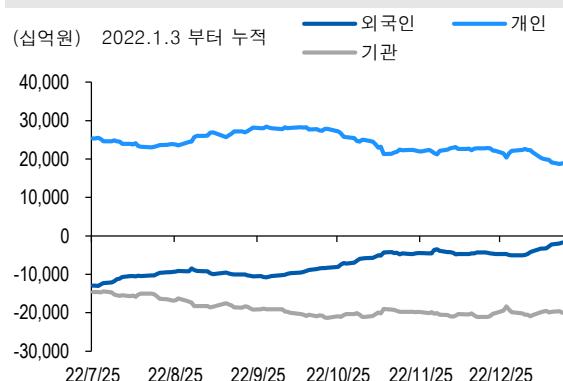
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	178.7	32.9	211.6	33.2	45.9	109.2	1.6	-0.4	0.0	-1.4
개인	127.9	51.2	179.1	0.0	0.5	48.6	12.8	-0.2	-0.8	-23.0
기관	-310.9	-87.4	-398.4	-0.3	-50.4	-249.0	-16.1	0.7	1.0	26.0
금융투자	-166.2	-62.2	-228.4	-0.3	-3.3	141.9	-9.6	0.8	0.4	28.6
투신	-7.2	13.3	6.0	0.0	-1.1	-377.5	-6.4	0.0	0.0	-4.8
은행+보험+기타금융	-25.1	-36.0	-61.1	0.0	-17.2	-15.7	-0.1	-0.1	0.5	0.2
연기금+국가지자체	-53.4	-7.5	-60.9	0.0	-9.2	2.3	0.0	0.0	0.0	1.9
기타법인	4.3	3.4	7.6	0.0	0.1	91.2	1.7	-0.1	-0.2	-1.6

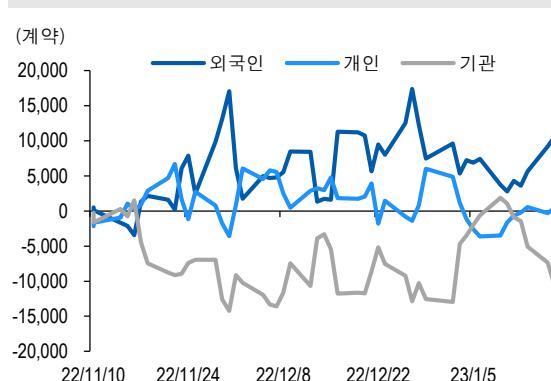
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	547,302	158.9	725,827	15.1%	지수옵션 전체	1,044,407	327.0	1,806,574
Put	497,105	168.1	1,080,747	15.8%	PCR(금액기준)	1.06	VKOSPI	16.85%(-0.03%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	322.5(K+3)	1.94	-0.80	53,228	15,694	3,052	15.2	317.5(K+1)
	320.0(K+2)	2.70	-0.94	32,533	18,507	1,396	15.3	315.0(K+0)
	317.5(K+1)	3.69	-1.08	9,204	7,479	220	15.6	312.5(K-1)
	315.0(K+0)	4.83	-1.30	7,880	11,752	659	15.8	310.0(K-2)
	312.5(K-1)	6.22	-1.46	1,952	11,226	-103	16.1	307.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	317.5(K+1)	6.44	1.03	4,320	2,537	345	14.9	
	315.0(K+0)	5.10	0.85	9,659	4,358	836	15.1	
	312.5(K-1)	3.94	0.65	15,488	9,580	691	15.3	
	310.0(K-2)	3.05	0.55	46,911	12,429	1,102	15.7	
	307.5(K-3)	2.32	0.40	47,346	8,631	602	16.0	

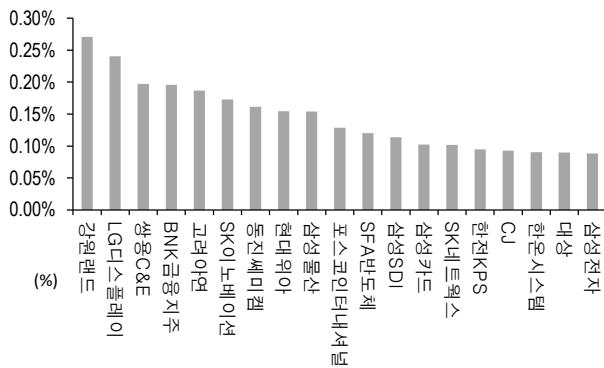
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,174,347	2,029.7	4,064,567	71,685	16,257	-30,553	15,402	-1.4	-23.0	26.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	166,500	0.00	72.2	96.6	33,031	302	-0.03%	650	-1,147	501
일진미터리얼즈	59,200	-0.84	9.6	94.0	33,689	-198	0.03%	-870	-308	678
현대건설	36,650	-0.95	21.2	91.8	41,156	6,333	-0.09%	-404	2,002	-1,598
삼성전자	61,200	-0.33	511.1	87.2	1,037,508	1,942	0.09%	3,115	22,044	-25,294
SK 하이닉스	86,300	0.00	111.2	81.9	164,520	-3,053	0.01%	-6,183	3,345	3,130
한국금융지주	61,500	-1.28	10.2	66.3	29,922	1,028	-0.11%	880	-1,030	150
삼성전기	148,500	-0.34	48.0	66.3	16,340	103	-0.21%	-2,804	475	2,442
엔씨소프트	468,000	-1.99	17.9	66.0	3,200	-33	-0.07%	97	71	-153
천보	213,000	-1.16	5.5	65.6	6,810	175	-0.19%	100	-67	-33
GS 건설	23,050	-0.22	14.4	65.0	57,395	11,615	-0.05%	10,971	-2,106	-8,865

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터