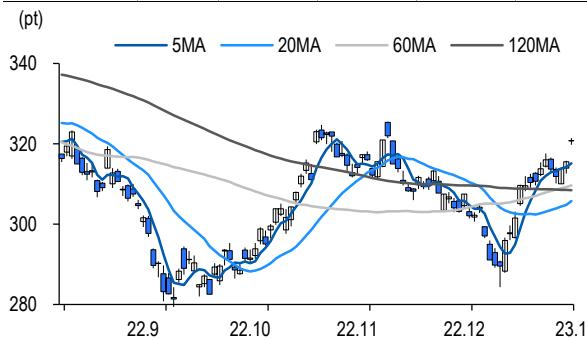


선물옵션시장 지표

2023.1.26

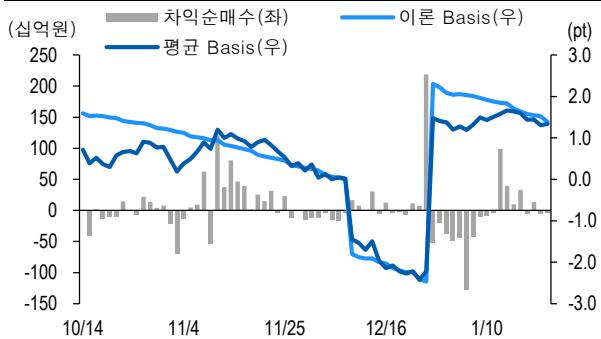
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	320.76	1.64	5.18	5,033.6	-
KSP2303	322.55	1.80	5.70	10,970.8	306,177
KSP2306	324.20	1.66	5.30	20.0	29,672
KSP2302(mini)	321.74	1.81	5.72	743.2	46,101
KSP2303(mini)	322.34	1.73	5.54	3.5	2,271



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.38	1.34	1.79	-0.01%
베이시스(mini)	0.48	0.53	0.98	0.01%
제1스프레드(SP)	2.12	1.96	1.95	-0.05%
합성선물 베이시스(ATM)	0.48	0.93	0.93	0.14%



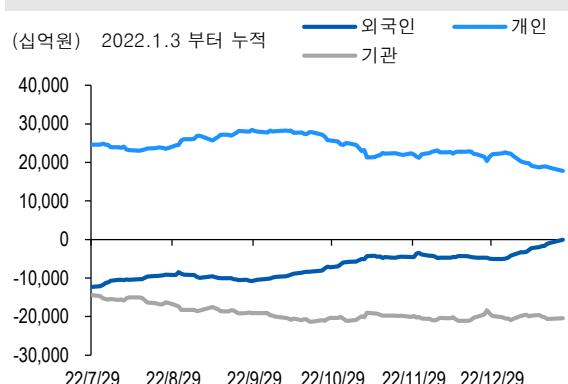
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	765.2	40.6	805.8	9.8	262.1	-91.1	28.8	5.3	0.4	-9.1
개인	-790.8	-33.4	-824.1	0.0	1.1	-177.3	-2.4	-7.1	-3.6	15.2
기관	27.5	123.1	150.7	-13.4	-63.6	300.8	-26.2	2.1	3.6	-9.5
금융투자	37.6	163.9	201.5	-11.7	-3.5	-113.7	-26.1	1.7	1.8	-14.8
투신	1.4	8.1	9.5	0.0	-7.1	286.2	0.1	0.4	0.0	5.4
은행+보험+기타금융	-22.8	-45.6	-68.5	0.0	-7.5	76.6	-0.1	0.0	1.8	0.0
연기금+국가지자체	4.3	-4.3	0.0	0.0	-39.8	51.8	0.0	0.0	0.0	-0.1
기타법인	-2.0	-131.1	-133.0	0.0	4.3	-32.4	-0.2	-0.3	-0.4	3.5

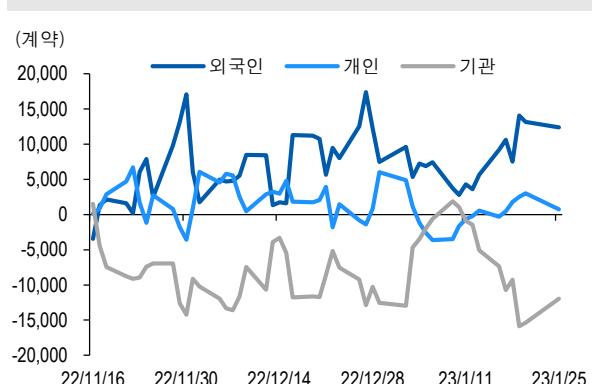
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	359,164	136.2	793,169		16.1%	지수옵션 전체	790,172	219.0	2,043,800						
Put	431,008	82.7	1,250,631		16.3%	PCR(금액기준)	0.61	VKOSPI	16.84%(+0.03%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	3.72	1.65	16,348	17,731	-1,202	16.0	Put	317.5(K+1)	2.51	-2.85	16,388	5,293	1,915	15.5
	320.0(K+2)	5.04	2.17	12,876	24,815	-12	16.4		315.0(K+0)	1.78	-2.36	32,316	10,518	3,551	15.8
	317.5(K+1)	6.68	2.78	2,613	12,035	-287	17.1		312.5(K-1)	1.24	-1.90	28,627	14,000	1,676	16.1
	315.0(K+0)	8.47	3.29	6,783	12,127	-2,531	17.7		310.0(K-2)	0.84	-1.50	40,511	19,959	5,462	16.4
	312.5(K-1)	10.10	3.44	696	13,479	-268	16.6		307.5(K-3)	0.57	-1.14	29,954	14,403	4,070	16.9

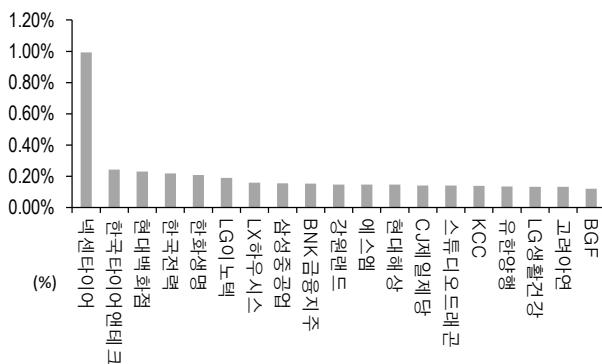
자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안티증권 리서치센-

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 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	1,614,247	1,208.0	4,262,992	36,476	-44,884	2,789	37,688	-9.1	15.2	-9.5		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
롯데케미칼	184,300	-1.71	9.6	56.3	38,286	-933	-0.18%	-272	857	-600	-332	-51
삼성전기	151,200	1.48	22.1	46.3	15,389	-1,582	0.01%	1,372	-798	-675	-1,176	240
신세계	236,000	0.00	3.7	46.3	3,792	-291	0.07%	-340	437	-418	-91	-327
호텔신라	82,500	-0.48	9.3	41.1	31,131	-2,561	-0.01%	-3,194	2,497	-952	-760	-77
LG 전자	97,300	0.72	16.0	41.0	26,659	1,790	0.10%	-883	1,976	-1,067	-1,261	196
현대제철	34,550	-1.99	3.3	40.3	20,029	-2,049	-0.10%	-981	-740	1,871	1,613	264
아모레퍼시픽	146,000	-1.68	12.2	40.3	16,648	-293	-0.08%	-799	403	396	549	165
일진마티리얼즈	61,200	2.68	4.0	37.9	34,205	1,135	0.11%	177	530	-707	-591	-116
삼성전자	63,400	2.26	383.6	36.0	1,074,734	18,075	-0.02%	2,909	-7,758	4,649	-4,484	1,990
LG 에너지솔루션	485,000	3.19	62.3	35.4	30,418	-2,253	-0.08%	186	957	-1,185	-1,361	36

자료: KRX, 유안티증권 리서치센-