

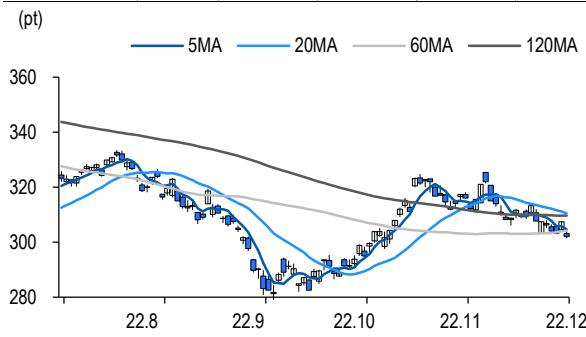


## 선물옵션시장 지표

2022.12.26

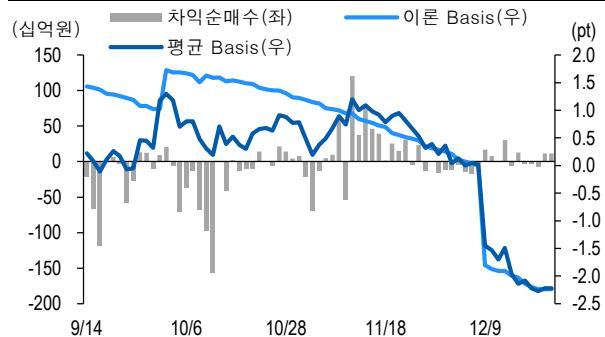
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	302.07	-1.76	-5.41	3,947.9	-
선물 3월물	299.45	-1.84	-5.60	17,925.5	283,476
선물 6월물	301.05	-1.92	-5.90	15.9	24,507
1월물(mini)	297.90	-1.85	-5.60	1,316.9	82,830
2월물(mini)	298.58	-1.94	-5.92	6.2	13,657



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-2.32	-2.42	-2.62	-0.03%
베이시스(mini)	-4.13	-3.97	-4.17	0.05%
제1스프레드(SP)	2.17	1.81	1.80	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	-4.13	-4.17	-4.17	-0.01%



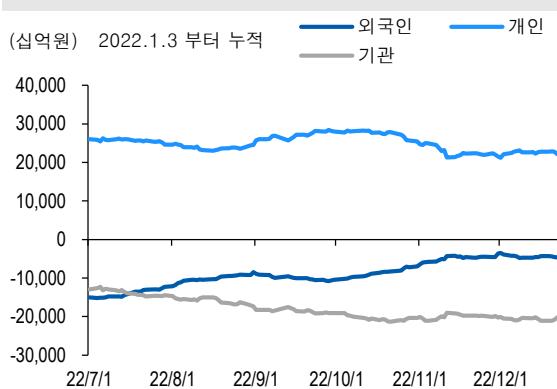
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

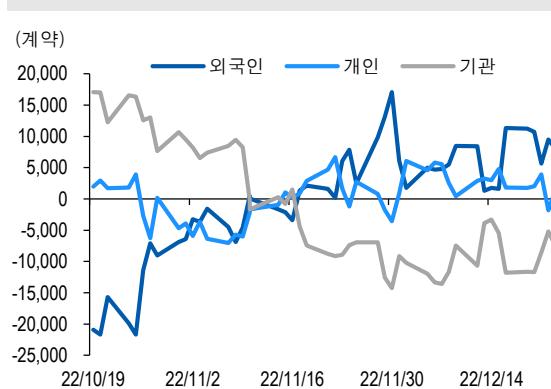
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-72.7	-17.4	-90.1	-0.6	-39.4	101.6	-212.7	-2.0	3.2	-25.0
개인	-181.8	32.1	-149.7	0.0	-2.8	229.8	15.2	-0.2	0.3	45.2
기관	251.4	-24.1	227.3	9.7	43.9	-372.3	194.9	2.3	-3.6	-19.9
금융투자	277.3	-38.8	238.5	15.6	-5.3	236.6	194.1	2.4	-3.7	4.4
투신	2.9	5.2	8.1	0.0	5.2	-599.0	-0.1	-0.1	0.0	-17.1
은행+보험+기타금융	-1.0	16.2	15.2	0.0	6.6	-16.6	0.9	-0.1	0.1	0.7
연기금+국가지자체	20.4	0.6	21.0	-6.0	36.2	6.7	0.0	0.0	0.0	-7.9
기타법인	3.1	9.4	12.6	0.0	-0.2	40.9	2.7	-0.1	0.0	-0.3

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	459,366	119.7	781,132	14.6%	지수옵션 전체	1,019,606	313.0	2,028,326							
Put	560,240	193.4	1,247,194	15.3%	PCR(금액기준)	1.62	VKOSPI	17.43% (+0.83%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	315.0(K+3)	0.26	-0.42	49,064	25,322	2,291	14.7	Put	310.0(K+1)	12.60	4.34	380	7,323	-129	13.9
	312.5(K+2)	0.41	-0.71	53,375	17,765	2,149	14.5		307.5(K+0)	10.65	4.08	1,755	6,186	423	14.9
	310.0(K+1)	0.68	-1.01	67,133	19,326	595	14.6		305.0(K-1)	8.69	3.56	2,033	10,225	-67	14.9
	307.5(K+0)	1.05	-1.47	69,126	13,374	1,432	14.5		302.5(K-2)	6.98	3.06	7,739	9,296	107	15.1
	305.0(K-1)	1.62	-1.93	49,892	16,635	430	14.7		300.0(K-3)	5.48	2.53	15,659	15,587	-84	15.4

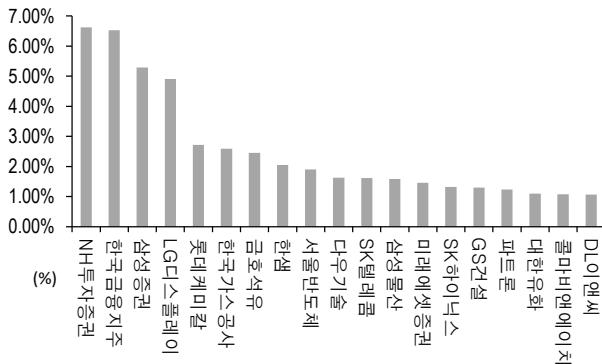
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	2,240,112	1,306.9	4,399,401	-20,456	-31,208	77,213	-45,187	-25.0	45.2	-19.9

종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수
넥센타이어	6,700	-0.74	0.4	96.0	3,423	34	-0.35%	-106	-24	130	130	0
삼성전자	58,000	-1.36	397.5	69.8	1,053,413	-20,286	-0.08%	-9,259	7,333	1,932	52,045	-6,601
롯데케미칼	175,500	3.85	18.5	67.8	22,972	-671	2.72%	3	-778	769	-1,356	-10
현대엘리베이	27,200	-3.37	1.7	65.0	4,189	-2,415	-0.56%	1,102	-3,491	2,389	2,389	0
현대제철	31,550	-0.16	5.0	60.5	39,551	5,785	0.23%	-1,041	5,436	-4,395	-4,347	-48
아모레퍼시픽	132,500	-1.12	12.4	56.8	13,707	-336	-0.09%	387	499	-886	-905	26
LG 이노텍	271,500	-2.34	22.7	56.5	24,441	1,749	0.28%	-518	1,766	-1,248	-1,236	-12
삼성전기	132,000	-2.58	19.1	53.8	15,521	-589	-0.32%	253	1,265	-1,518	-1,473	-45
엔씨소프트	424,500	-1.96	9.5	46.8	3,359	-155	-0.18%	-77	31	36	-42	78
일진미터리얼즈	52,300	-3.51	5.6	46.2	37,373	-683	-0.29%	-388	-1,011	1,399	1,378	21

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터