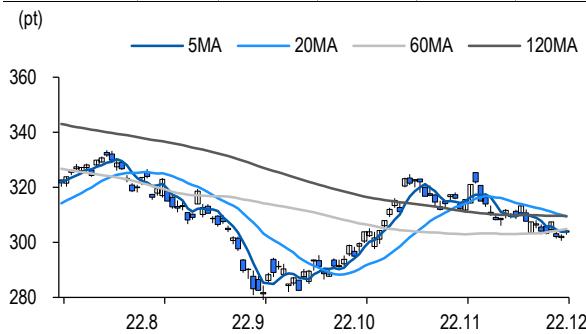


## 선물옵션시장 지표

2022.12.28

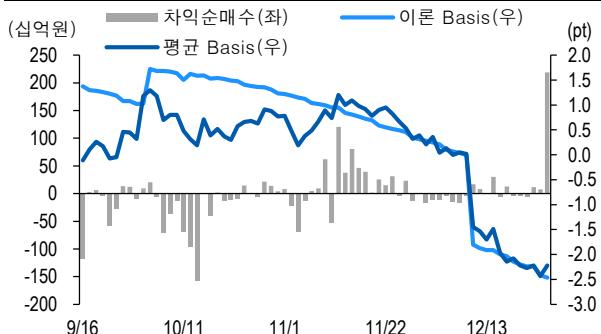
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	304.22	0.65	1.95	4,924.0	-
선물 3월물	302.30	0.78	2.35	16,104.1	285,573
선물 6월물	304.10	0.66	2.00	10.6	24,550
1월물(mini)	300.52	0.70	2.08	1,144.1	98,531
2월물(mini)	301.34	0.67	2.02	7.3	9,303



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-2.46	-2.22	-1.92	0.08%
베이시스(mini)	-4.27	-3.87	-3.70	0.13%
제1스프레드(SP)	2.19	1.82	1.85	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	-4.27	-3.65	-3.65	0.20%



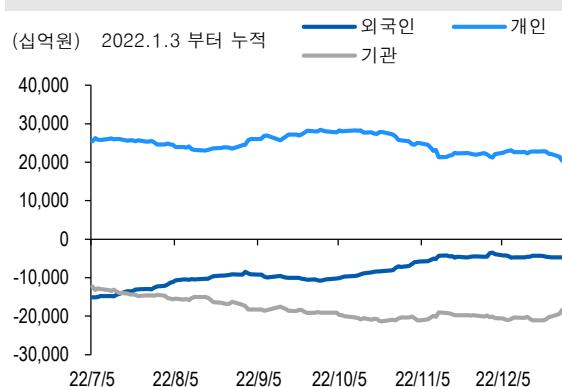
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

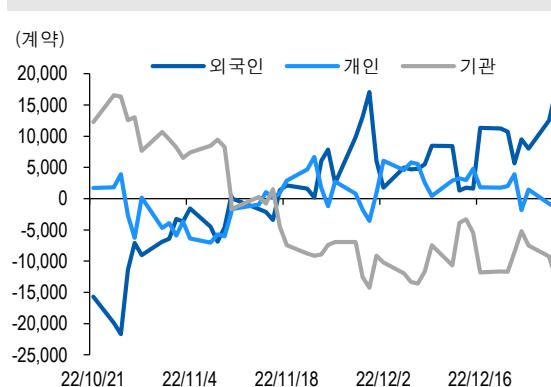
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	48.2	24.2	72.4	0.7	1.7	453.7	-86.8	-4.6	5.8	4.7
개인	-1,133.0	11.4	-1,121.6	0.0	-33.8	-89.2	41.2	0.2	2.8	46.6
기관	1,097.9	-47.9	1,050.0	218.2	98.7	-321.4	46.3	4.4	-8.7	-52.2
금융투자	942.7	-133.8	808.9	209.6	9.7	-632.1	47.2	4.1	-8.0	-83.3
투신	60.5	19.2	79.7	5.4	45.4	333.1	0.1	0.1	-0.4	31.4
은행+보험+기타금융	84.9	22.7	107.6	8.5	74.0	-53.2	-1.0	0.0	0.0	-2.7
연기금+국가지자체	-66.9	20.9	-46.0	-5.2	-34.4	30.8	0.0	0.1	-0.3	2.4
기타법인	-13.1	12.3	-0.8	0.0	-6.5	-43.1	-0.7	0.0	0.1	0.9

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	436,396	123.9	829,923	15.0%	지수옵션 전체	864,712	250.9	2,108,820							
Put	428,316	127.0	1,278,897	14.9%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	17.09%(-0.37%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	310.0(K+3)	0.74	0.17	77,670	25,439	4,368	14.6	Put	305.0(K+1)	6.38	-1.62	2,528	10,230	-21	12.6
	307.5(K+2)	1.23	0.33	73,062	17,021	2,467	14.9		302.5(K+0)	4.86	-1.46	10,411	12,332	2,788	13.3
	305.0(K+1)	1.97	0.50	61,011	17,405	139	15.3		300.0(K-1)	3.65	-1.23	17,268	19,143	3,015	14.1
	302.5(K+0)	2.93	0.70	41,843	17,608	3,758	15.7		297.5(K-2)	2.66	-0.98	20,619	13,222	1,020	14.7
	300.0(K-1)	4.19	0.93	15,366	10,484	1,215	16.3		295.0(K-3)	1.89	-0.79	41,325	21,072	1,334	15.2

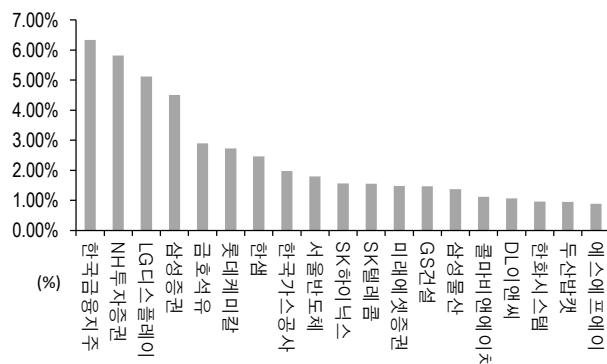
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	2,274,575	1,286.1	4,624,977	142,805	64,884	104,311	-169,646	4.7	46.6	-52.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	6,700	2.29	0.4	89.5	2,995	-1,019	-1.50%	799	432	-1,231
일진미티리얼즈	54,400	4.82	8.8	62.7	33,934	-2,364	-0.21%	2,111	-3,022	911
롯데케미칼	181,500	0.55	10.5	60.4	21,517	-1,376	2.73%	-869	-520	1,386
LG 전자	89,000	0.45	27.0	54.7	29,492	-7,187	-0.20%	0	9,566	-9,566
삼성전자	58,100	0.87	327.4	52.9	1,077,733	19,513	0.09%	-11,655	27,309	-15,695
NAVER	181,000	0.84	43.7	49.5	26,193	1,205	0.05%	-230	1,490	-1,262
카카오	54,500	1.68	32.2	48.6	62,429	-1,250	-0.07%	-2,695	652	1,986
아모레퍼시픽	139,500	5.68	29.4	48.4	11,030	-2,605	-0.10%	1,779	22	-1,761
LG 이노텍	268,500	-0.37	29.1	47.4	19,323	-3,346	0.00%	-87	-3,335	3,363
삼성 SDI	626,000	-0.16	50.9	45.7	17,505	892	0.25%	-192	313	-141

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터