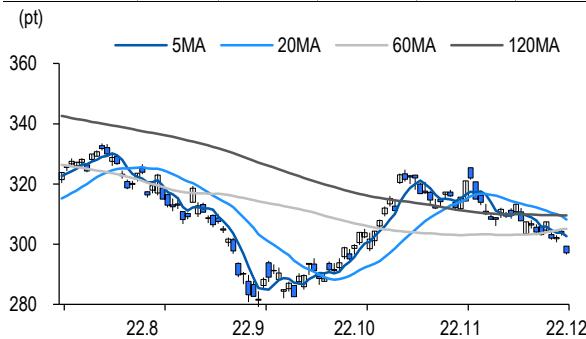


선물옵션시장 지표

2022.12.29

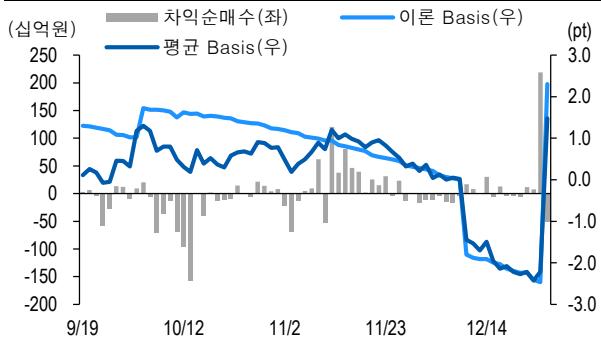
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	297.09	-2.34	-7.13	5,402.3	-
선물 3월물	298.45	-1.27	-3.85	17,578.5	295,511
선물 6월물	300.20	-1.28	-3.90	15.1	24,576
1월물(mini)	296.98	-1.18	-3.54	1,112.9	87,851
2월물(mini)	297.50	-1.27	-3.84	5.0	9,265



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	2.30	1.48	1.36	-0.28%
베이시스(mini)	0.49	-0.05	-0.11	-0.18%
제1스프레드(SP)	2.17	1.88	1.85	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.49	-0.09	-0.09	-0.19%



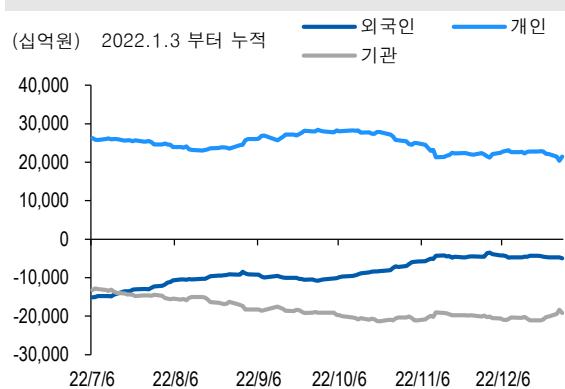
투자주체별 매매 동향

(십억원)

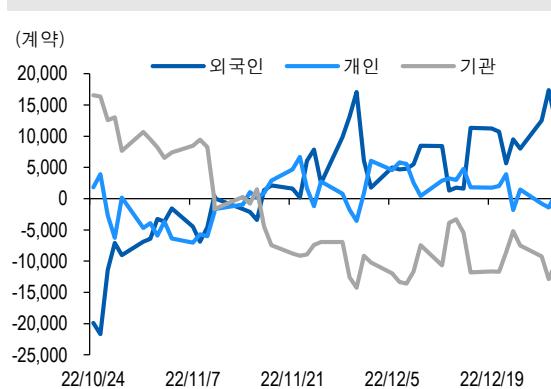
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-303.1	38.0	-265.1	-4.4	-213.9	-427.1	43.2	0.2	4.3	-33.3
개인	1,077.2	-14.1	1,063.1	0.0	31.6	214.2	-46.0	-0.7	-2.6	-46.8
기관	-828.7	-24.3	-853.0	-47.8	63.6	194.2	-1.0	0.6	-1.9	85.5
금융투자	-768.7	37.0	-731.7	-41.9	-1.5	544.7	0.4	1.0	-2.9	123.3
투신	56.9	-9.3	47.6	0.0	50.9	-356.5	-0.8	-0.2	0.4	-34.9
은행+보험+기타금융	-15.0	-34.8	-49.8	0.0	-5.1	3.7	-0.7	0.0	0.4	2.8
연기금+국가지자체	-0.6	0.3	-0.3	0.0	40.8	2.2	0.0	-0.1	0.3	-5.7
기타법인	54.6	0.5	55.1	0.0	0.3	18.8	3.8	-0.2	0.2	-5.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)															
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	477,987	120.7	852,669	13.8%	지수옵션 전체	912,198	284.2	2,140,281							
Put	434,211	163.5	1,287,612	16.5%	PCR(금액기준)	1.35	VKOSPI	17.53% (+0.44%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	312.5(K+3)	0.17	-0.27	42,963	26,642	3,379	13.9	Put	307.5(K+1)	11.10	2.94	456	6,140	10	18.1
	310.0(K+2)	0.31	-0.43	61,214	27,912	2,473	13.8		305.0(K+0)	8.95	2.57	1,618	10,241	11	17.1
	307.5(K+1)	0.56	-0.67	69,269	20,970	3,949	13.8		302.5(K-1)	7.05	2.19	4,579	12,000	-332	16.7
	305.0(K+0)	0.95	-1.02	75,598	17,246	-159	13.8		300.0(K-2)	5.40	1.75	13,734	17,693	-1,450	16.5
	302.5(K-1)	1.55	-1.38	62,635	17,970	362	13.8		297.5(K-3)	4.02	1.36	17,717	13,781	559	16.4

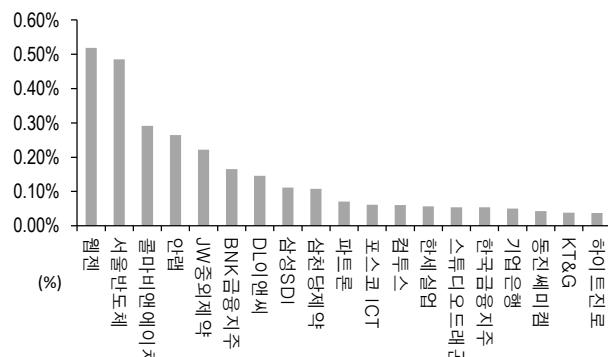
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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	3,021,741	1,684.2	4,560,161	-64,816	-63,638	-70,384	141,567	-33.3	-46.8	85.5
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	6,340	-5.37	1.0	96.3	4,148	1,153	-0.80%	-931	-124	1,055
한국금융지주	55,200	-1.78	9.8	67.4	26,365	761	0.05%	1,242	489	-1,731
NAVER	181,000	0.00	61.8	59.2	24,153	-2,040	-0.06%	1,597	-3,178	1,603
엔씨소프트	433,000	1.17	17.1	51.9	3,539	78	-0.14%	208	-258	50
BGF	4,300	2.38	0.5	51.4	3,743	-79	-0.44%	-523	-542	1,065
삼성전자	56,700	-2.41	419.2	50.9	1,111,105	33,372	0.03%	1,636	24,269	-18,919
롯데케미칼	183,500	1.10	8.4	50.4	21,706	189	-0.66%	-227	194	38
SK 하이닉스	75,900	-1.43	70.1	49.3	178,920	-3,803	-0.13%	-3,641	-5,448	9,093
LG 전자	89,300	0.34	21.4	49.0	30,798	1,306	-0.17%	491	-3,541	3,059
LG 이노텍	263,500	-1.86	29.6	48.7	18,919	-404	-0.07%	-1,105	-266	1,433

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터