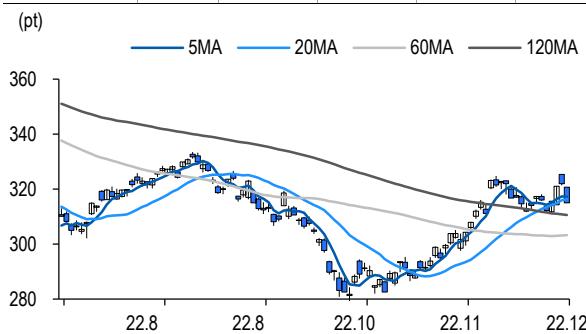


선물옵션시장 지표

2022.12.5

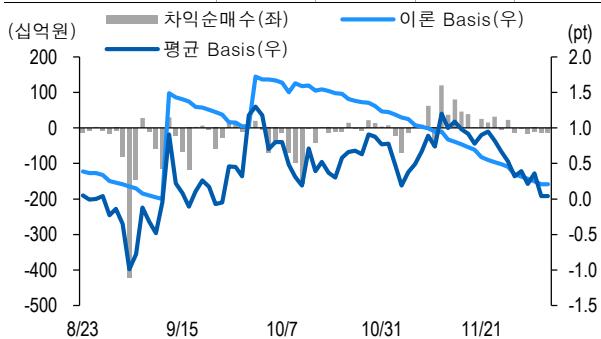
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	315.02	-2.17	-7.00	5,355.5	-
선물 12월물	315.00	-2.51	-8.10	23,507.4	304,840
선물 3월물	313.55	-2.53	-8.15	916.9	48,608
12월물(mini)	315.00	-2.51	-8.10	1,283.9	51,061
1월물(mini)	312.34	-2.45	-7.86	28.7	29,374



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.21	0.04	-0.02	-0.05%
베이시스(mini)	0.21	0.04	-0.02	-0.05%
제1스프레드(SP)	-1.71	-1.51	-1.50	0.06%
합성선물 베이시스(ATM)	0.21	0.03	0.03	-0.06%



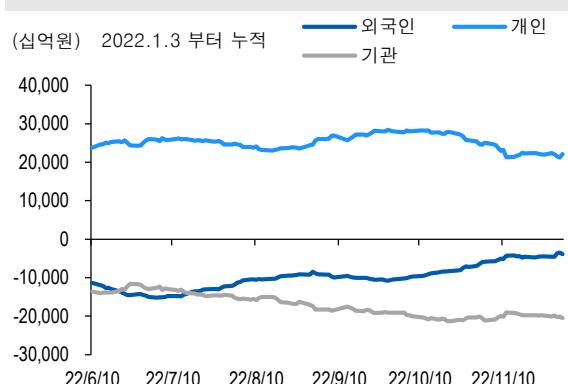
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-403.3	-9.2	-412.5	-8.4	-352.5	-275.8	-74.9	-3.6	-6.8	-31.0
개인	909.2	-26.9	882.3	0.0	-0.3	327.9	84.9	3.6	10.2	17.9
기관	-509.2	29.6	-479.6	-3.6	14.3	-71.7	-11.2	0.7	-8.2	12.8
금융투자	-332.6	9.5	-323.0	-3.6	32.2	591.1	-9.9	1.2	-8.1	37.5
투신	-32.5	1.6	-31.0	0.0	-3.2	-660.9	-1.3	-0.3	-0.1	-23.9
은행+보험+기타금융	-25.3	17.3	-8.1	0.0	1.2	17.6	0.0	-0.1	0.0	0.4
연기금+국가지자체	-41.2	0.9	-40.3	0.0	-0.4	-19.4	0.0	0.0	0.0	-1.2
기타법인	3.4	6.5	9.9	0.0	0.7	19.6	1.2	-0.8	4.8	0.3

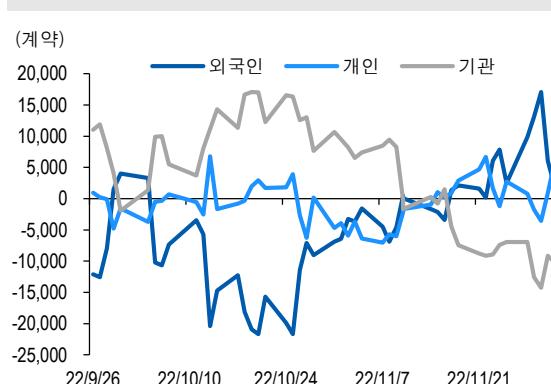
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,759,681	348.6	1,180,057	16.8%	지수옵션 전체		3,287,671	799.0	2,981,626
Put	1,527,990	450.4	1,801,569	17.6%	PCR(금액기준)		1.29	VKOSPI	18.49% (+0.98%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	330.0(K+3)	0.10	-0.45	141,412	49,499	2,110	17.8	325.0(K+1)	10.25
	327.5(K+2)	0.17	-0.91	270,161	33,663	9,421	17.0	322.5(K+0)	8.07
	325.0(K+1)	0.32	-1.60	409,514	40,874	13,326	16.6	320.0(K-1)	6.07
	322.5(K+0)	0.62	-2.51	253,956	35,069	11,407	16.6	317.5(K-2)	4.30
	320.0(K-1)	1.11	-3.58	179,756	34,430	6,494	16.4	315.0(K-3)	2.93
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	325.0(K+1)	10.25	6.44	6,656	7,444	-1,238	19.1	322.5(K+0)	8.07
	322.5(K+0)	8.07	5.58	13,047	16,879	-1,349	18.5	320.0(K-1)	6.07
	320.0(K-1)	6.07	4.51	77,978	23,066	-4,587	18.0	317.5(K-2)	4.30
	317.5(K-2)	4.30	3.36	147,991	16,693	-1,897	17.5	315.0(K-3)	2.93
	315.0(K-3)	2.93	2.38	236,404	30,597	1,431	17.6		

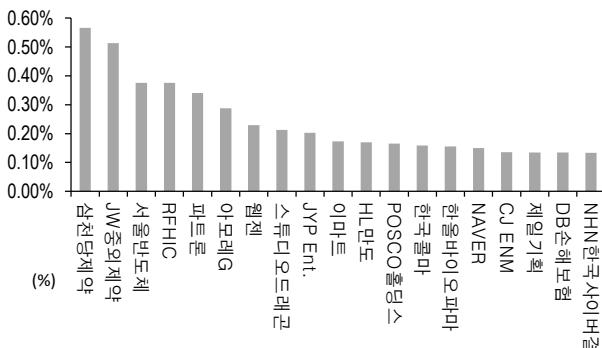
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,354,809	2,054.4	5,150,137	-76,090	-80,917	64,676	12,675	-31.0	17.9	12.8
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대제철	33,750	-1.89	7.5	76.8	14,852	-152	0.03%	-832	71	761
현대차	168,000	-2.33	58.8	76.6	40,218	-2,236	0.03%	-2,673	-262	2,954
일진미터리얼즈	61,200	-3.77	5.7	71.7	50,927	-530	0.05%	-957	665	298
삼성전자	60,700	-3.19	589.3	63.8	955,004	-87,780	0.01%	-446	19,339	-18,993
메리츠증권	6,050	-1.63	9.4	62.2	122,441	1,543	-0.13%	-1,989	3,175	-1,186
LG전자	96,300	0.00	46.1	58.8	32,309	-1,153	-0.03%	1,773	-4,218	2,442
넥센타이어	7,000	-0.85	0.3	55.0	2,522	-346	-0.04%	-761	7	754
삼성SDI	718,000	-1.37	49.6	54.9	18,716	-520	0.06%	-4	-201	227
삼성전기	136,000	-0.37	29.3	54.9	16,388	-175	-0.23%	-167	-308	385
엔씨소프트	468,500	0.75	17.4	49.2	4,274	-73	0.06%	436	-46	-390

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터