

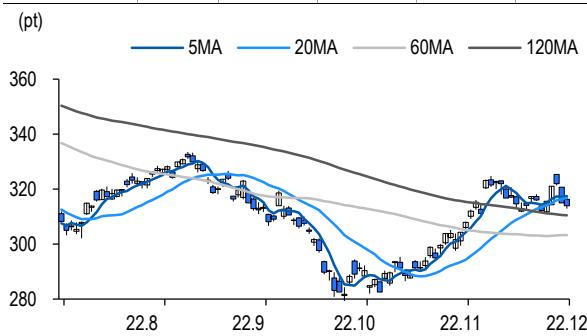


선물옵션시장 지표

2022.12.6

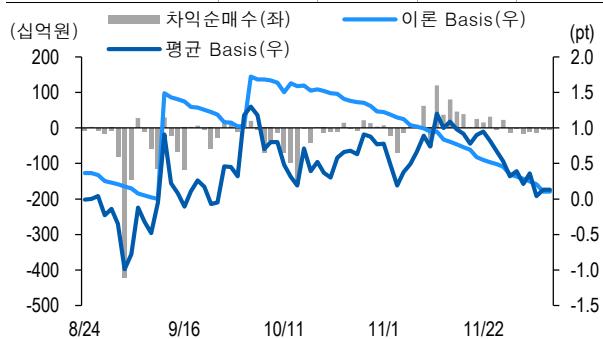
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.91	-0.35	-1.11	6,102.7	-
선물 12월물	314.35	-0.21	-0.65	22,720.7	248,772
선물 3월물	312.95	-0.19	-0.60	1,219.9	98,795
12월물(mini)	314.46	-0.17	-0.54	1,404.5	54,267
1월물(mini)	311.66	-0.22	-0.68	41.5	32,776



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.10	0.13	0.44	0.01%
베이시스(mini)	0.10	0.13	0.55	0.01%
제1스프레드(SP)	-1.72	-1.42	-1.35	0.09%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	0.48	0.48	0.12%



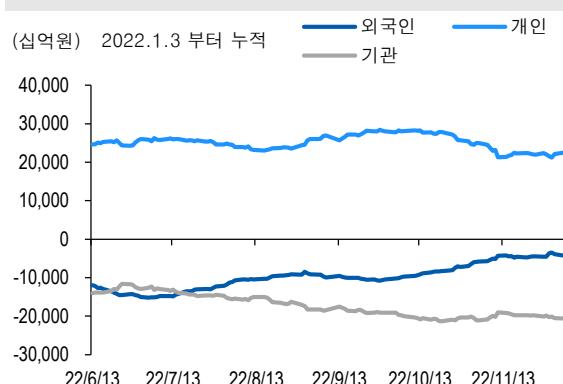
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-292.3	4.9	-287.4	-2.7	-183.1	249.8	7.0	-0.2	0.9	-10.0
개인	301.6	15.1	316.8	0.0	-1.5	-106.6	-11.3	0.3	2.4	11.8
기관	-15.2	-20.3	-35.5	-1.5	-67.4	-140.2	4.2	1.1	-2.3	-1.0
금융투자	113.0	-16.3	96.7	-1.6	-46.6	-250.8	1.5	1.3	-1.3	4.6
투신	-28.9	-9.7	-38.6	0.0	-18.2	202.9	2.8	-0.5	0.1	-1.7
은행+보험+기타금융	-5.6	11.5	5.9	0.0	-3.2	-91.4	-0.1	0.3	-1.2	-0.3
연기금+국가지자체	-2.3	-0.3	-2.6	0.1	-0.8	-0.9	0.0	0.0	0.0	-3.7
기타법인	5.9	0.3	6.1	0.0	-0.1	-3.0	0.1	-1.2	-0.9	-0.7

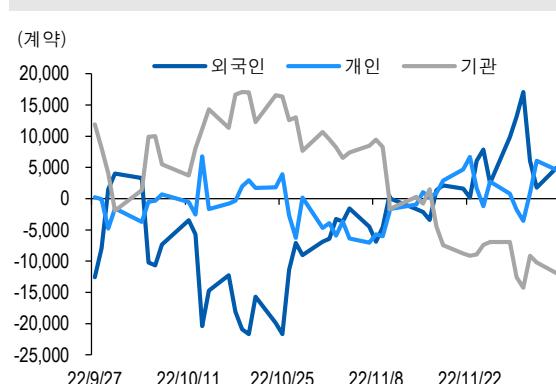
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,934,539	371.2	1,232,683	17.8%	지수옵션 전체		3,559,921	766.0	3,075,614						
Put	1,625,382	394.9	1,842,931	17.2%	PCR(금액기준)		1.06	VKOSPI	17.98%(-0.51%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	0.19	-0.43	365,708	40,187	5,118	17.5	Put	317.5(K+1)	4.11	-0.19	41,336	15,560	-1,133	14.5
	320.0(K+2)	0.46	-0.65	443,687	42,145	7,715	17.5		315.0(K+0)	2.60	-0.33	164,736	28,593	-2,004	15.9
	317.5(K+1)	1.01	-0.84	300,368	24,121	5,649	17.8		312.5(K-1)	1.47	-0.41	261,192	28,316	1,016	16.5
	315.0(K+0)	1.99	-0.96	155,706	21,949	2,334	18.6		310.0(K-2)	0.79	-0.38	333,848	33,672	3,718	17.4
	312.5(K-1)	3.33	-1.09	30,255	12,756	1,946	19.0		307.5(K-3)	0.40	-0.27	285,417	25,561	2,381	18.2

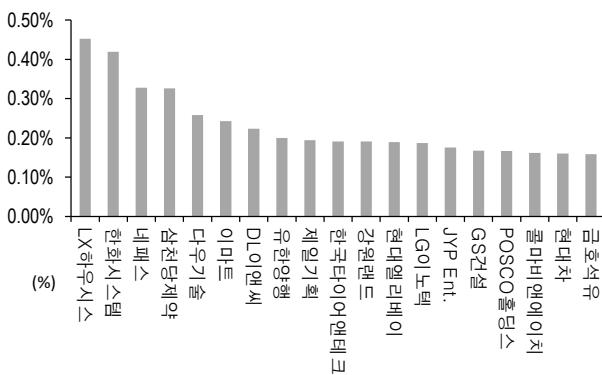
자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

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	3,641,498	2,525.0	5,175,864	25,727	-35,341	6,050	28,561	-10.0	11.8	-1.0	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수
삼성전자	60,400	-0.49	733.2	88.3	841,394	-113,610	0.05%	22,505	-7,239	-15,526	-21,530
LG 전자	97,100	0.83	29.8	66.7	29,522	-2,787	-0.05%	-4,431	-178	4,609	4,622
LG 이노텍	299,500	-2.76	69.5	61.3	8,219	-4,557	0.19%	-1,452	8,623	-7,181	-5,645
현대차	166,000	-1.19	79.4	60.7	39,994	-224	0.16%	-1,576	340	1,330	398
삼성전기	140,000	2.94	71.3	60.0	16,563	175	-0.26%	531	-1,519	827	854
삼성 SDI	696,000	-3.06	90.7	58.9	17,161	-1,555	0.01%	-311	-1,117	1,470	1,811
일진마티리얼즈	59,600	-2.61	7.0	52.0	47,997	-2,930	0.02%	-2,957	-789	3,746	3,228
KB 금융	52,500	0.38	19.7	50.2	54,617	-1,160	-0.04%	-6,045	-738	6,813	5,948
현대제철	33,600	-0.44	4.3	49.9	12,551	-2,301	-0.16%	1,237	-387	-850	-912
롯데케미칼	189,000	5.00	15.8	48.3	21,837	-404	-0.14%	684	-134	-542	-91

자료: KRX, 유안티증권 리서치센-