

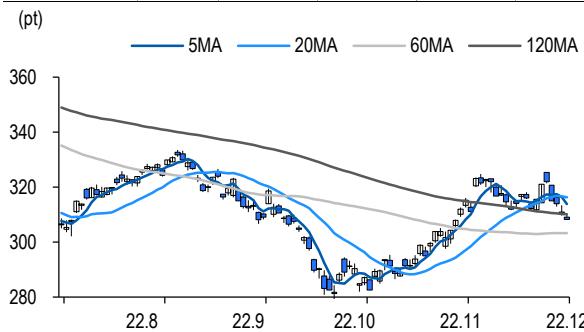


선물옵션시장 지표

2022.12.8

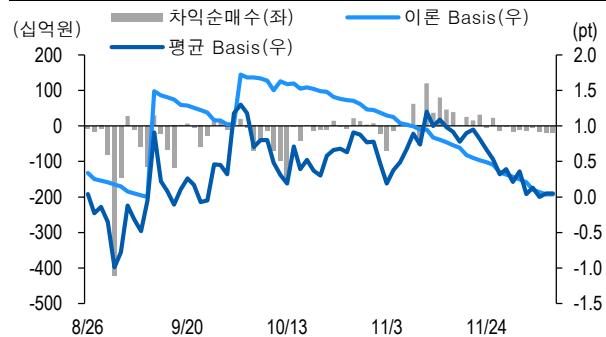
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	308.27	-0.60	-1.87	4,533.5	-
선물 12월물	308.20	-0.63	-1.95	20,769.2	129,794
선물 3월물	306.50	-0.49	-1.50	5,411.9	236,863
12월물(mini)	308.22	-0.63	-1.88	1,248.8	56,841
1월물(mini)	304.98	-0.61	-1.86	75.7	38,546



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.03	0.05	-0.07	0.01%
베이시스(mini)	0.03	0.06	-0.05	0.01%
제1스프레드(SP)	-1.78	-1.70	-1.65	0.03%
합성선물 베이시스(ATM)	0.03	-0.07	-0.07	-0.03%



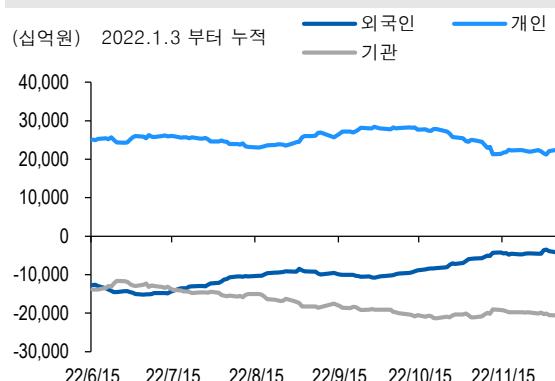
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-197.5	13.5	-184.0	-17.0	-47.1	16.3	-15.2	1.9	4.4	19.5
개인	199.4	1.3	200.8	0.0	-0.2	-26.3	7.7	-2.9	1.6	14.6
기관	-17.2	-24.7	-41.9	-0.5	-20.1	-15.6	5.1	2.5	-4.3	-32.2
금융투자	114.2	15.5	129.7	-1.6	1.7	33.2	4.8	2.9	-4.2	-29.9
투신	-12.3	-14.8	-27.1	0.0	-9.4	-45.0	0.4	-0.3	0.2	1.7
은행+보험+기타금융	1.2	-17.5	-16.3	0.0	1.4	-21.1	0.0	-0.1	-0.3	-0.5
연기금+국가지자체	-25.8	0.5	-25.3	0.0	-7.3	17.3	0.0	0.0	0.0	-3.5
기타법인	15.3	9.9	25.1	0.0	-0.1	25.6	2.4	-1.5	-1.7	-1.9

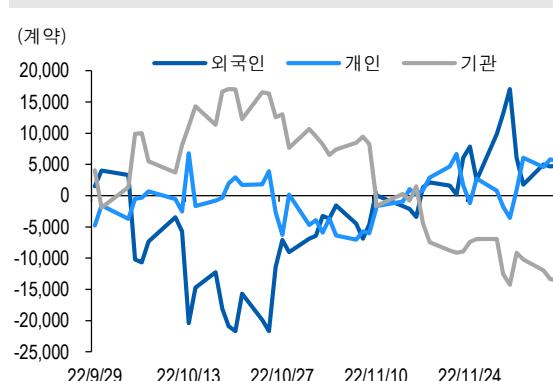
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,063,116	347.9	1,360,923	14.7%	지수옵션 전체	3,998,571	768.1	3,291,576
Put	1,935,455	420.2	1,930,653	16.6%	PCR(금액기준)	1.21	VKOSPI	18.45% (+0.26%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	317.5(K+3)	0.01	-0.09	150,417	41,697	12	16.4	312.5(K+1)
	315.0(K+2)	0.03	-0.30	414,394	51,399	19,396	14.6	310.0(K+0)
	312.5(K+1)	0.16	-0.73	679,566	39,091	14,378	14.3	307.5(K-1)
	310.0(K+0)	0.65	-1.28	481,135	38,606	13,562	14.4	305.0(K-2)
	307.5(K-1)	1.79	-1.76	133,906	13,761	7,583	14.6	302.5(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	312.5(K+1)	4.48	1.31	65,899	23,451	-1,304	17.6	310.0(K+0)
	310.0(K+0)	2.45	0.73	287,615	30,661	-1,850	16.1	307.5(K-1)
	307.5(K-1)	1.07	0.22	505,527	25,951	2,106	16.0	305.0(K-2)
	305.0(K-2)	0.37	0.00	498,205	38,964	4,838	16.3	302.5(K-3)
	302.5(K-3)	0.12	-0.03	274,396	47,484	8,799	17.4	

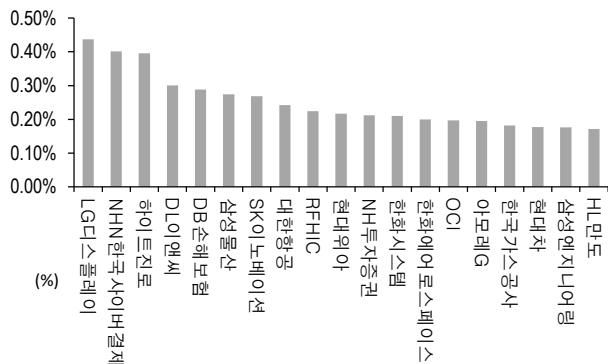
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,476,636	2,286.4	5,224,620	-10,592	52,008	67,789	-117,614	19.5	14.6	-32.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
LG 디스플레이	14,000	-1.41	14.7	129.0	120,412	-29,108	0.44%	-5,230	19,970	-14,940
삼성전자	59,000	-0.84	552.4	77.8	563,010	-141,390	0.09%	19,841	29,433	-46,991
삼성전기	134,500	-1.10	23.0	74.9	12,258	-2,706	0.14%	829	-498	-171
일진마티리얼즈	59,700	2.58	7.4	74.4	20,833	-18,283	0.07%	915	-830	-485
삼성 SDI	708,000	0.57	71.7	64.8	12,716	-2,476	0.00%	364	-578	217
현대차	163,000	-0.61	38.0	62.0	37,194	-2,173	0.18%	762	-73	-693
한국금융지주	57,100	-0.87	4.0	59.3	8,048	-7,501	0.13%	-843	831	12
NAVER	184,000	-1.08	70.1	58.9	38,966	-2,669	0.03%	-34	-89	220
엔씨소프트	458,500	1.55	16.7	57.6	3,435	-466	0.08%	212	-98	-114
롯데케미칼	189,000	2.16	23.4	53.6	16,319	-5,429	-0.02%	-677	2,108	-1,428

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터