

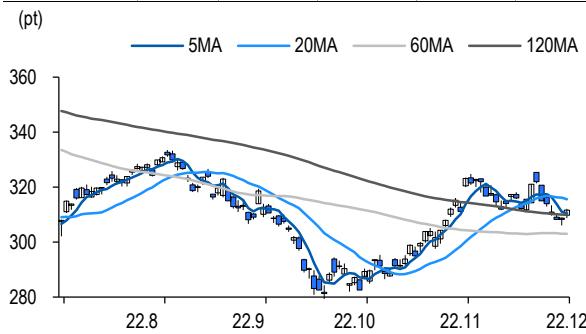


## 선물옵션시장 지표

2022.12.12

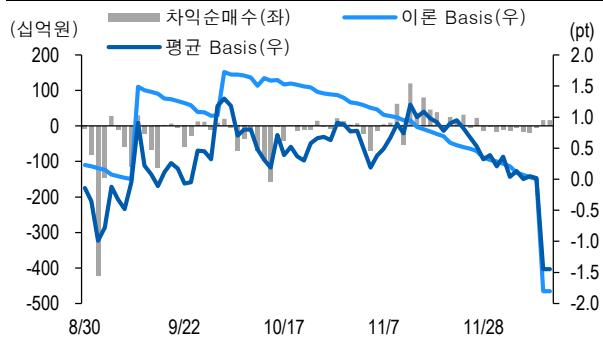
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	311.63	1.10	3.39	5,757.6	-
선물 3월물	310.65	1.19	3.65	22,502.5	270,621
선물 6월물	312.40	1.17	3.60	16.6	24,011
1월물(mini)	308.98	1.13	3.44	1,441.0	60,156
2월물(mini)	309.60	1.06	3.24	2.1	13,135



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-1.80	-1.45	-0.98	0.11%
베이시스(mini)	-3.67	-2.97	-2.65	0.22%
제1스프레드(SP)	2.25	1.79	1.80	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	-3.67	-2.50	-2.50	0.37%



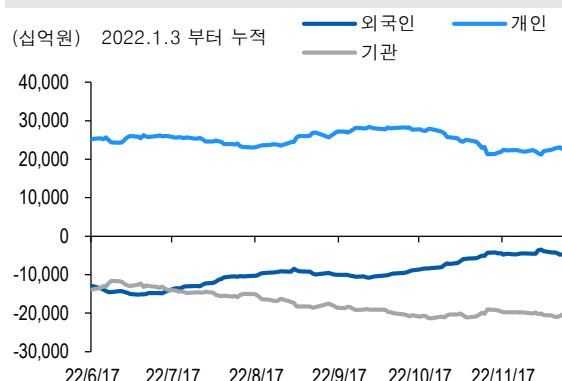
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	98.5	14.1	112.6	8.3	82.0	-220.5	-2.0	3.5	-6.0	36.0
개인	-508.6	-4.2	-512.8	0.0	0.3	-106.5	0.5	-2.3	-2.2	32.1
기관	407.6	-10.3	397.3	8.4	-14.7	389.0	1.6	-1.0	8.3	-69.8
금융투자	404.2	-32.1	372.1	5.3	3.7	-61.2	1.0	-0.9	8.7	-29.9
투신	-26.5	3.3	-23.2	0.0	-18.0	496.9	1.5	-0.1	-0.3	-7.3
은행+보험+기타금융	-10.7	15.4	4.7	0.0	2.2	-55.1	-0.9	0.0	0.0	0.5
연기금+국가지자체	22.3	0.0	22.3	1.6	-6.6	8.3	0.0	0.0	0.0	-33.1
기타법인	2.5	0.4	2.9	0.0	0.7	-61.9	-0.1	-0.2	-0.1	1.8

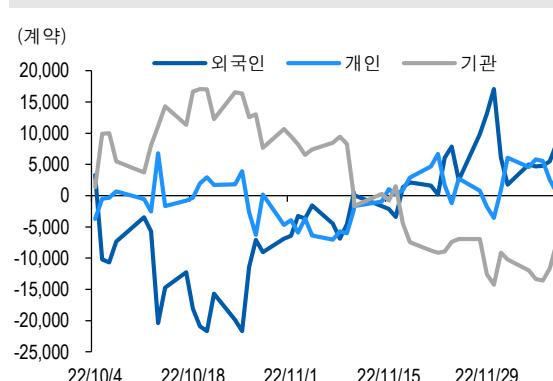
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이

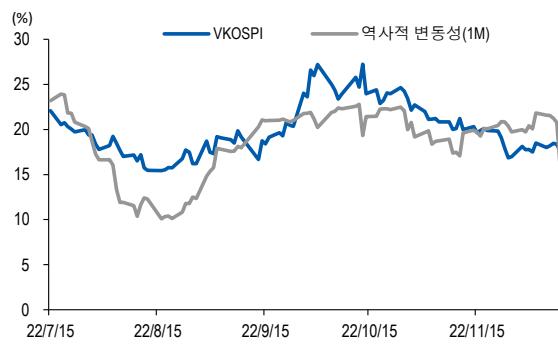


## 선물옵션시장 지표

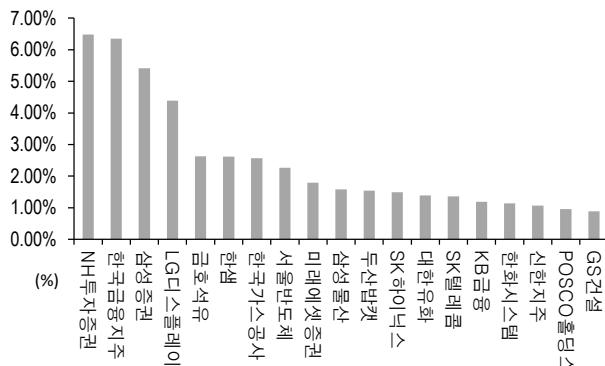
### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	517,970	199.1	557,857	17.2%	지수옵션 전체	976,286	390.8	1,434,725						
Put	458,316	191.7	876,868	16.1%	PCR(금액기준)	0.96	VKOSPI	17.57%(-0.81%p)						
<hr/>														
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
	315.0(K+3)	3.63	0.88	38,299	11,221	2,776	17.1	Put						
	312.5(K+2)	4.61	1.08	17,256	5,373	1,570	17.4	310.0(K+1)	6.64	-2.34	7,401	5,737	780	14.6
	310.0(K+1)	5.78	1.37	12,225	6,786	1,517	17.7	307.5(K+0)	5.46	-2.00	9,184	4,042	620	15.0
	307.5(K+0)	7.09	1.54	9,192	4,328	1,553	18.1	305.0(K-1)	4.60	-1.64	12,031	8,025	305	15.8
	305.0(K-1)	8.59	2.02	2,789	4,650	468	18.6	302.5(K-2)	3.73	-1.47	9,558	3,602	134	16.2
	<hr/>													
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터														

### 역시적 변동성과 VKOSPI



### 주식선물 평균베이시스 괴리율



### 주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	3,213,432	2,009.5	3,767,476	426,996	95,201	75,051	-173,746	36.0	32.1	-69.8	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
삼성전자	60,100	2.04	535.5	85.3	1,026,169	44,158	-0.01%	18,786	15,777	-36,037	-31,429
삼성전기	136,000	1.49	30.5	68.6	11,934	3,054	-0.45%	-973	-680	1,645	2,111
일진마티리얼즈	57,500	-3.69	8.4	62.6	42,947	-735	-0.09%	285	-1,439	1,156	1,156
메리츠증권	5,640	-0.53	5.3	60.8	86,921	4,616	-0.07%	-4,615	1,296	3,319	3,319
LG 이노텍	285,500	1.24	36.3	58.5	13,233	3,509	0.29%	-1,352	3,402	-2,038	-1,551
호텔신라	79,400	1.15	16.6	51.7	14,258	3,959	-0.22%	1,194	-1,342	148	251
현대제철	32,300	5.90	10.0	51.3	14,425	5,122	0.09%	-1,776	2,897	-1,166	-453
대한유화	168,000	1.20	5.1	51.0	1,896	519	1.39%	-361	-155	515	515
한국조선해양	74,000	1.51	5.1	50.4	2,883	756	-0.16%	-551	47	506	742
한국금융지주	56,200	1.81	3.8	50.1	24,069	942	6.35%	-211	-22	233	379
											-146