

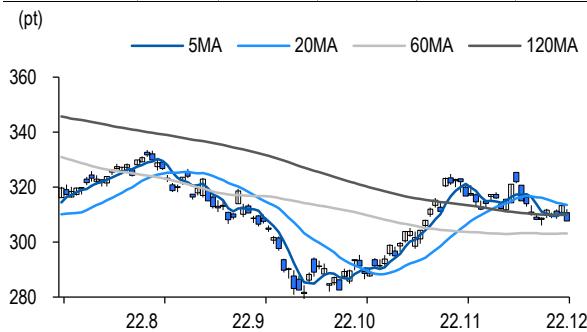


선물옵션시장 지표

2022.12.16

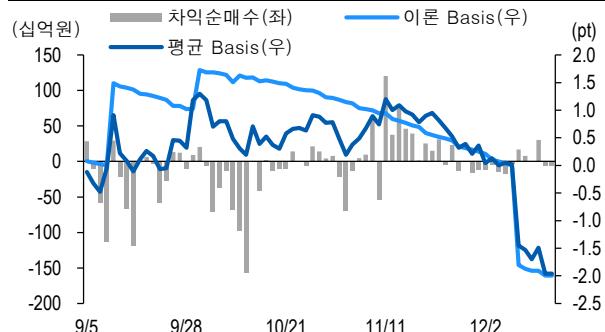
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	307.73	-1.76	-5.50	4,162.4	-
선물 3월물	306.15	-1.69	-5.25	19,899.7	286,881
선물 6월물	308.10	-1.63	-5.10	17.8	23,828
1월물(mini)	304.66	-1.67	-5.18	1,286.1	66,229
2월물(mini)	305.40	-1.60	-4.98	1.2	13,196



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-2.00	-1.96	-1.58	0.01%
베이시스(mini)	-3.84	-3.46	-3.07	0.12%
제1스프레드(SP)	2.23	1.85	1.85	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	-3.84	-2.90	-2.90	0.30%



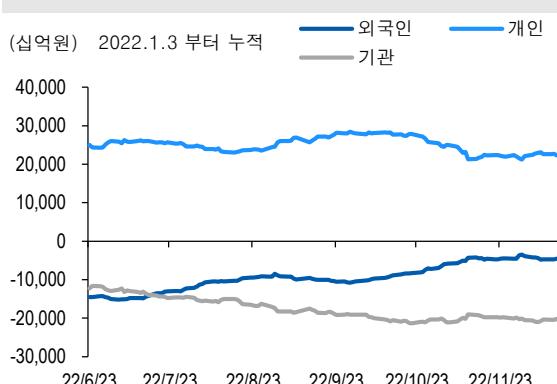
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-57.4	37.7	-19.7	-5.5	-0.4	-32.2	20.3	-1.3	-3.3	-28.2
개인	458.1	27.0	485.1	0.0	3.7	128.9	11.1	1.3	-0.3	35.9
기관	-436.1	-84.2	-520.4	0.0	-41.2	-130.3	-31.4	0.0	3.8	-7.0
금융투자	-297.3	-64.7	-362.0	0.0	0.3	436.9	-30.9	0.1	4.7	31.3
투신	-8.7	8.0	-0.8	0.0	1.8	-518.6	-0.2	0.0	0.0	-45.5
은행+보험+기타금융	-27.9	0.5	-27.4	0.0	-12.6	-45.7	-0.3	0.0	-0.8	0.4
연기금+국가지자체	-32.8	-1.0	-33.8	0.0	-17.1	-2.9	0.0	0.0	0.0	6.8
기타법인	35.5	19.4	54.9	0.0	0.0	33.6	0.0	0.0	-0.2	-0.7

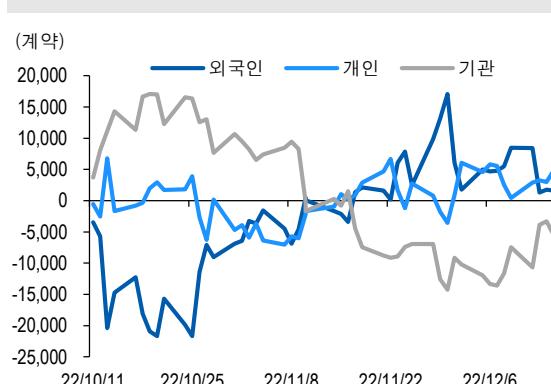
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	494,807	127.9	650,150	15.2%	지수옵션 전체	899,668	277.9	1,706,469							
Put	404,861	150.0	1,056,319	13.8%	PCR(금액기준)	1.17	VKOSPI	16.71%(-0.56%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	320.0(K+3)	0.72	-1.12	74,897	21,342	3,224	15.1	Put	315.0(K+1)	11.65	2.96	494	2,644	188	11.0
	317.5(K+2)	1.06	-1.45	48,966	14,190	13	15.2		312.5(K+0)	9.84	2.82	2,431	3,813	403	12.3
	315.0(K+1)	1.54	-1.81	40,949	15,318	1,285	15.4		310.0(K-1)	8.23	2.52	7,637	7,606	1,528	13.3
	312.5(K+0)	2.17	-2.14	25,153	10,172	2,333	15.7		307.5(K-2)	6.70	2.07	5,113	5,748	391	13.7
	310.0(K-1)	2.94	-2.61	18,314	11,434	3,411	15.8		305.0(K-3)	5.39	1.68	7,861	9,677	527	14.1

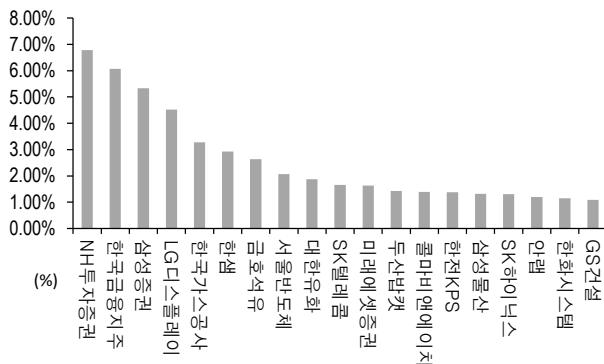
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,320,306	1,398.6	4,197,376	101,942	-56,710	63,695	-3,832	-28.2	35.9	-7.0		
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수		
일진머티리얼즈	58,000	-2.36	6.7	86.1	42,922	673	0.28%	-1,579	1,845	-266	-331	71
삼성전자	59,500	-1.49	398.2	77.0	1,125,168	59,462	0.09%	-17,785	37,784	-19,884	-12,639	-7,000
롯데케미칼	165,000	-2.08	18.8	74.3	21,292	3,694	0.64%	2,650	322	-2,977	185	-125
LG 전자	87,900	-1.46	14.7	68.2	29,517	-156	-0.42%	-1,436	1,662	-228	1,041	2,461
현대차	159,500	-0.93	38.2	61.5	35,981	578	0.20%	1,969	-741	-1,268	-1,331	8
한화솔루션	48,600	-1.92	30.2	58.0	73,510	7,156	-0.13%	-6,600	-908	7,956	7,805	151
삼성 SDI	666,000	-0.60	71.5	54.4	14,055	-10	0.03%	-338	-167	505	263	392
한국전력	20,950	0.48	16.5	48.3	88,513	-6,107	-0.23%	-3,779	-6,139	10,060	7,734	2,326
현대제철	32,000	-0.47	3.0	47.8	20,572	266	-0.06%	193	-299	106	106	0
삼성전기	137,500	-2.14	17.1	47.8	13,928	-823	-0.53%	-992	-573	1,559	1,586	-27

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터