

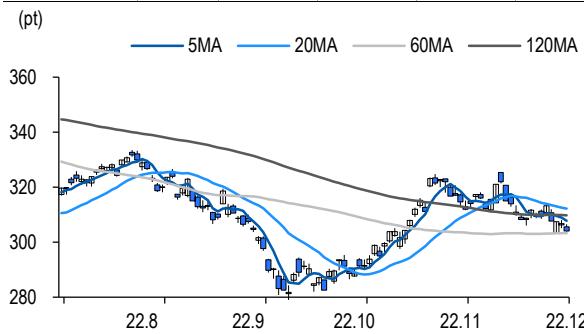


선물옵션시장 지표

2022.12.21

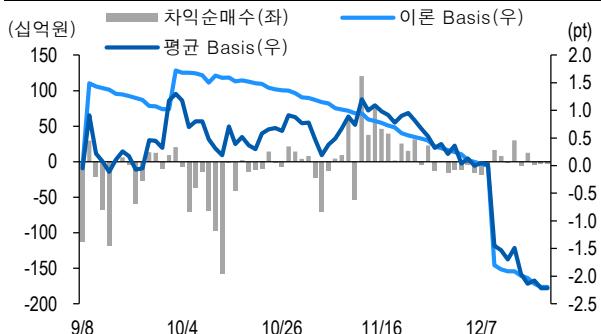
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	304.05	-0.89	-2.72	3,665.9	-
선물 3월물	301.90	-0.80	-2.45	23,669.4	281,130
선물 6월물	303.70	-0.85	-2.60	26.3	24,008
1월물(mini)	300.48	-0.79	-2.40	1,478.3	75,982
2월물(mini)	300.94	-0.98	-2.98	2.0	13,251



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-2.20	-2.22	-2.15	-0.01%
베이시스(mini)	-4.02	-3.72	-3.57	0.10%
제1스프레드(SP)	2.19	1.84	1.95	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	-4.02	-3.64	-3.64	0.12%



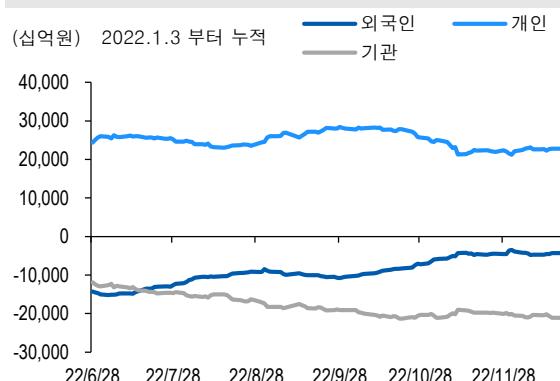
투자주체별 매매 동향

(십억원)

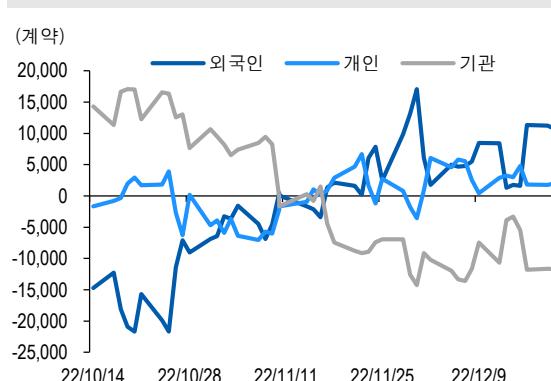
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-104.1	-11.4	-115.5	-6.0	-72.0	43.6	-79.2	0.9	-3.2	-6.7
개인	105.0	-13.4	91.6	0.0	-2.0	8.9	13.7	-1.4	1.7	28.9
기관	-26.8	25.3	-1.5	2.8	-41.0	-71.4	64.2	0.7	1.4	-20.4
금융투자	33.9	-8.1	25.8	4.3	-5.6	220.5	64.9	0.9	1.4	-1.3
투신	-10.3	17.6	7.4	0.0	-7.5	-269.2	0.0	-0.2	0.1	-18.6
은행+보험+기타금융	-13.0	8.1	-4.9	0.0	-10.6	-17.5	-0.7	0.0	0.0	0.1
연기금+국가지자체	-31.1	9.3	-21.8	-1.5	-23.2	-5.3	0.0	0.0	0.0	-0.6
기타법인	25.9	-0.5	25.4	0.0	-0.3	19.0	1.3	-0.2	0.1	-1.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)															
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	618,078	164.4	725,965	15.7%	지수옵션 전체	1,276,412	399.8	1,923,837							
Put	658,334	235.4	1,197,872	15.8%	PCR(금액기준)	1.43	VKOSPI	17.98% (+0.38%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	315.0(K+3)	0.64	-0.40	81,489	19,417	1,416	15.4	Put	310.0(K+1)	11.10	1.81	489	7,481	-114	14.4
	312.5(K+2)	0.98	-0.55	76,539	12,096	-105	15.6		307.5(K+0)	9.23	1.62	2,480	5,643	101	14.8
	310.0(K+1)	1.50	-0.68	82,823	15,916	903	16.0		305.0(K-1)	7.57	1.40	8,575	10,340	141	15.2
	307.5(K+0)	2.14	-0.89	48,746	13,103	1,709	16.1		302.5(K-2)	6.13	1.22	7,710	7,286	-12	15.6
	305.0(K-1)	3.00	-1.07	28,430	13,951	3,932	16.5		300.0(K-3)	4.87	1.03	14,902	15,375	-630	16.0

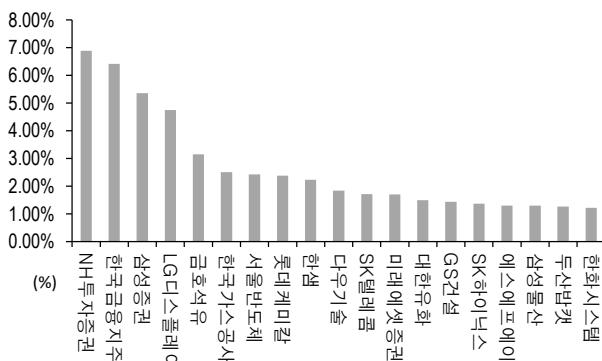
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,397,339	1,460.7	4,244,675	21,666	-3,734	54,150	-46,454	-6.7	28.9	-20.4
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
일진마티리얼즈	54,800	-1.79	7.4	78.9	39,809	-1,869	-0.29%	-697	-1,475	2,372
삼성전자	58,500	-1.35	411.2	78.0	1,034,641	-23,084	0.02%	-23,243	46,810	-23,082
현대차	152,500	-1.29	105.0	74.8	37,051	799	-0.02%	3,658	-3,563	-179
삼성 SDI	646,000	-0.31	56.9	68.6	14,558	108	0.10%	30	297	-322
한샘	44,050	-1.34	0.8	65.9	1,628	234	2.23%	-234	-57	292
넥센타이어	6,680	-3.05	0.8	64.5	3,193	-453	-0.13%	-485	-87	572
한화	27,300	1.87	2.0	63.3	9,860	1,144	0.08%	222	441	-663
NAVER	180,000	-1.91	68.7	60.9	29,501	-897	0.01%	1,054	-1,253	249
롯데케미칼	161,500	-1.82	8.4	58.6	23,794	1,361	2.38%	423	271	-666
카카오	54,200	-3.04	43.8	57.7	57,558	-2,362	-0.17%	-6,140	6,310	-83

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터