

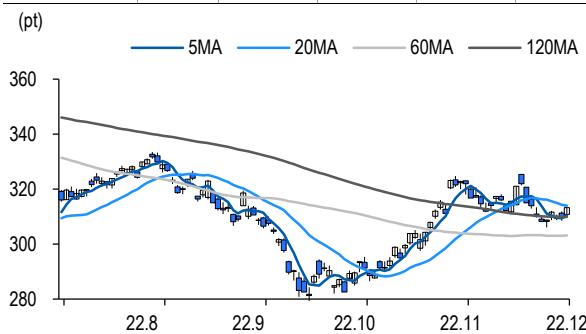


## 선물옵션시장 지표

2022.12.15

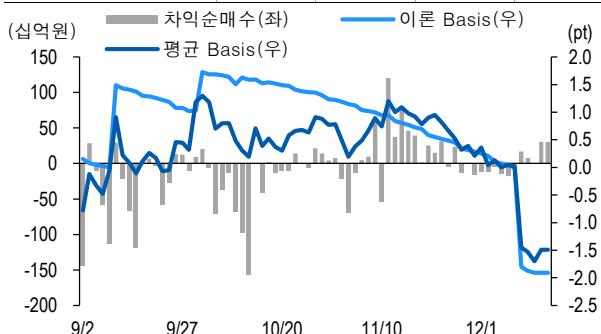
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.23	1.19	3.67	4,257.8	-
선물 3월물	311.40	1.01	3.10	19,034.0	277,714
선물 6월물	313.20	1.05	3.25	12.7	23,810
1월물(mini)	309.84	1.01	3.10	1,243.5	64,899
2월물(mini)	310.38	1.04	3.18	0.9	13,181



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-1.91	-1.49	-1.83	0.13%
베이시스(mini)	-3.79	-3.08	-3.39	0.23%
제1스프레드(SP)	2.28	1.89	1.80	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	-3.79	-3.39	-3.39	0.13%



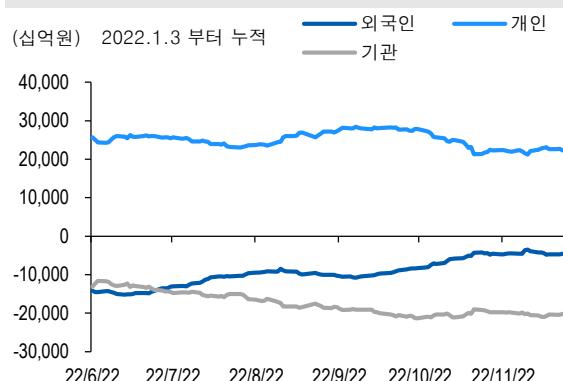
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	218.3	-28.0	190.3	4.2	223.3	71.4	-39.5	-0.7	-2.0	25.5
개인	-452.3	23.4	-428.9	0.0	1.5	-8.0	-10.3	0.8	-0.5	-8.8
기관	227.8	9.8	237.6	26.1	0.0	-4.6	49.0	0.1	2.8	-17.3
금융투자	212.8	-9.3	203.5	19.8	1.3	-416.5	46.9	0.0	2.0	-13.8
투신	8.9	4.7	13.6	0.0	2.8	398.0	1.9	0.0	0.0	1.2
은행+보험+기타금융	-5.5	10.2	4.7	0.0	3.3	6.2	0.2	0.0	0.9	-0.1
연기금+국가지자체	2.8	-2.1	0.8	0.0	-13.4	7.7	0.0	0.0	0.0	-4.6
기타법인	6.2	-5.1	1.0	0.0	0.2	-58.8	0.8	-0.2	-0.4	0.6

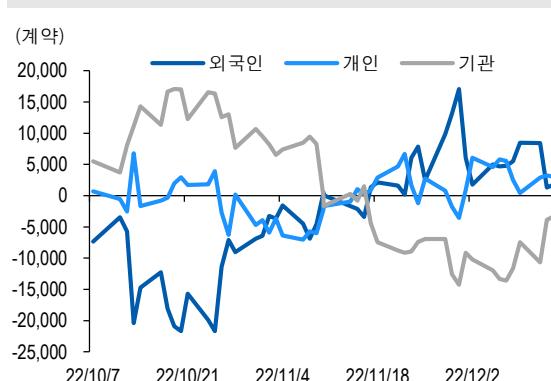
자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	403,866	140.5	625,063	15.8%	지수옵션 전체	855,074	268.7	1,645,974							
Put	451,208	128.2	1,020,911	16.2%	PCR(금액기준)	0.91	VKOSPI	17.27%(-1.82%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	317.5(K+3)	2.51	0.25	38,015	14,177	1,056	15.8	Put	312.5(K+1)	7.02	-2.62	2,434	3,410	217	15.1
	315.0(K+2)	3.35	0.42	21,588	14,033	-22	16.0		310.0(K+0)	5.71	-2.34	5,950	6,078	189	15.4
	312.5(K+1)	4.31	0.52	10,776	7,839	112	16.1		307.5(K-1)	4.63	-2.09	4,127	5,357	99	15.8
	310.0(K+0)	5.55	0.75	7,334	8,023	-413	16.5		305.0(K-2)	3.71	-1.83	8,151	9,150	79	16.1
	307.5(K-1)	6.90	0.94	2,713	6,809	282	16.7		302.5(K-3)	2.92	-1.61	15,497	6,035	1,063	16.4

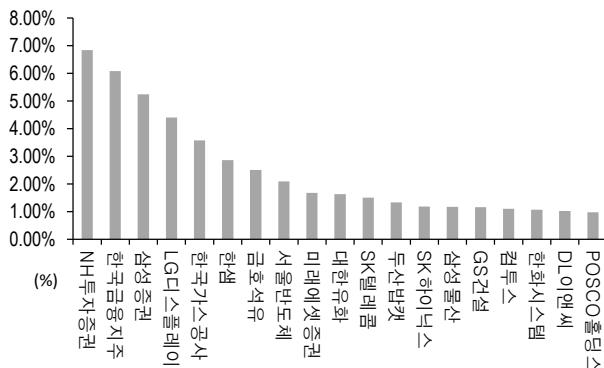
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터