

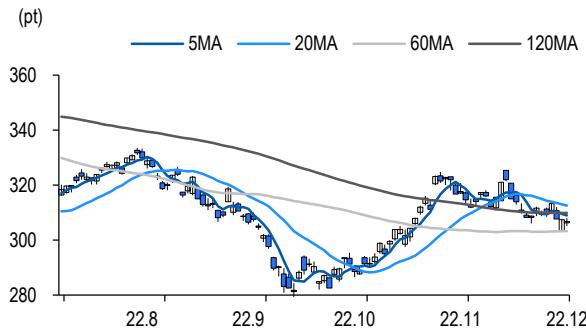


## 선물옵션시장 지표

2022.12.20

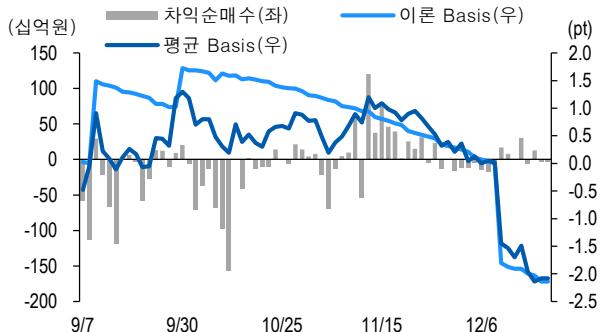
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	306.77	-0.23	-0.71	3,288.5	-
선물 3월물	304.35	0.10	0.30	14,801.3	281,990
선물 6월물	306.30	0.07	0.20	16.7	23,894
1월물(mini)	302.88	0.11	0.32	1,037.7	73,163
2월물(mini)	303.92	0.24	0.72	0.3	13,236



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-2.14	-2.08	-2.42	0.02%
베이시스(mini)	-3.98	-3.58	-3.89	0.13%
제1스프레드(SP)	2.21	1.85	1.80	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	-3.98	-3.85	-3.85	0.04%



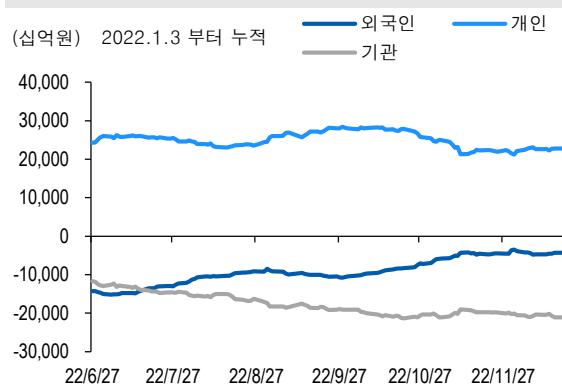
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-24.2	16.6	-7.6	-9.3	-57.8	-46.9	39.7	-1.3	0.2	-2.0
개인	-17.8	3.0	-14.8	0.0	-0.9	17.4	-23.8	-0.1	-0.3	-9.4
기관	28.2	-21.3	6.9	5.4	-59.0	27.1	-15.7	1.3	0.1	9.9
금융투자	86.6	-14.3	72.3	5.3	-3.6	-181.3	-15.7	1.5	-0.2	25.1
투신	-9.3	-10.7	-19.9	0.0	-21.8	140.2	0.0	-0.2	0.0	-14.0
은행+보험+기타금융	-14.0	6.2	-7.8	0.0	-8.2	70.9	0.0	0.0	0.3	0.0
연기금+국가지자체	-7.3	1.6	-5.6	0.0	-3.2	-2.8	0.0	0.0	0.0	-1.2
기타법인	13.8	1.7	15.5	0.0	0.0	2.4	-0.3	0.0	0.0	1.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정						
Call	392,552		117.2	690,974		15.3%	지수옵션 전체		760,006	232.3					
Put	367,454		115.1	1,164,190		16.2%	PCR(금액기준)		0.98	VKOSPI					
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	315.0(K+3)	1.04	-0.09	72,733	18,001	1,885	15.2	Put	310.0(K+1)	9.29	-0.30	669	7,595	6	15.3
	312.5(K+2)	1.53	-0.10	48,010	12,201	460	15.4		307.5(K+0)	7.61	-0.33	2,964	5,542	-118	15.5
	310.0(K+1)	2.18	-0.10	35,222	15,013	1,754	15.6		305.0(K-1)	6.17	-0.27	3,662	10,199	132	15.8
	307.5(K+0)	3.03	-0.04	19,429	11,394	1,534	15.8		302.5(K-2)	4.91	-0.25	5,272	7,298	107	16.1
	305.0(K-1)	4.07	-0.03	10,795	10,019	1,128	16.1		300.0(K-3)	3.84	-0.23	10,486	16,005	-234	16.3

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

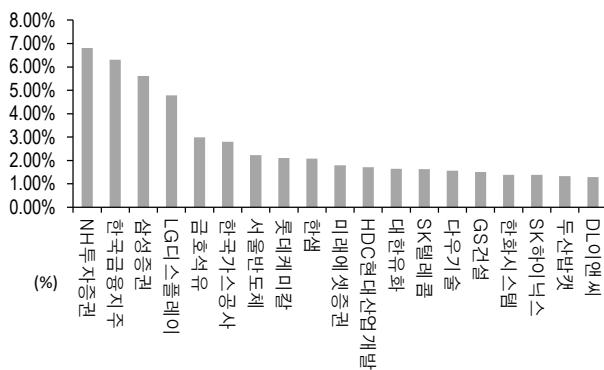
역사적 변동성과 VKOSPI



---

자료: KRX, 유안타증권 리서치센트

## 주식선물 평균베이시스 괴리율



---

자료: KRX, 유안타증권 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	2,000,647	1,205.4	4,223,009	48,452	14,357	759	-18,925	-2.0	-9.4	9.9		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	59,300	0.34	354.2	83.6	1,057,725	-5,183	-0.10%	-7,753	3,761	4,016	11,003	-6,900
카카오	55,900	2.19	56.5	75.3	59,920	6,961	-0.11%	5,921	-3,468	-2,588	-11,405	5,067
현대제철	31,150	0.00	4.7	71.6	27,915	3,748	0.24%	1,524	3,538	-5,062	-5,001	-61
LG 생활건강	677,000	-2.03	13.1	70.8	1,363	50	0.24%	35	22	-57	247	122
한울바이오파마	16,150	0.94	0.7	68.7	6,168	562	0.01%	645	-91	-554	-554	0
현대차	154,500	-2.52	76.1	65.7	36,252	941	-0.11%	-3,387	363	2,626	7,118	586
영원무역	43,650	-0.68	1.9	64.0	2,554	725	-0.43%	342	-1,774	1,432	1,432	0
일진마티리얼즈	55,800	-3.79	5.0	53.6	41,678	-1,872	-0.15%	-652	-1,394	2,106	1,941	165
넷마블	50,900	2.00	3.4	52.4	6,555	903	0.68%	834	-20	-1,114	-1,057	-58
웹젠	15,600	-2.19	0.2	52.3	1,050	-16	-0.02%	62	7	-68	-68	0

---

자료: KRX, 유안타증권 리서치센트