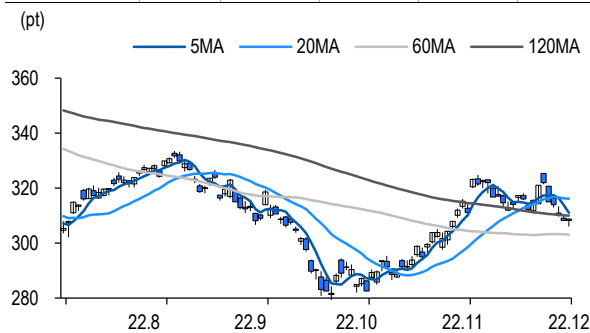


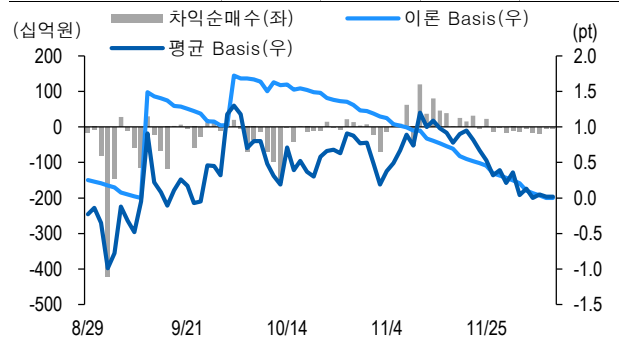
선물옵션시장 지표

2022.12.9

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	308.24	-0.01	-0.03	6,053.9	-
선물 12월물	307.60	-0.19	-0.60	13,264.1	0
선물 3월물	307.00	0.16	0.50	9,129.9	268,147
12월물(mini)	307.62	-0.19	-0.60	452.9	0
1월물(mini)	305.54	0.18	0.56	891.1	54,775



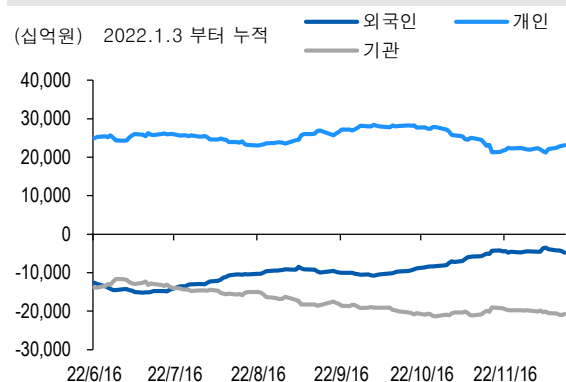
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.00	0.02	-0.64	0.01%
베이스(mini)	0.00	0.02	-0.62	0.01%
제1스프레드(SP)	-1.77	-1.60	-1.35	0.06%
합성선물 베이스(ATM)	0.00	-0.66	-0.66	-0.21%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-474.1	51.4	-422.7	-1.8	-351.6	154.5	-106.2	5.3	-1.4	32.7
개인	207.0	-19.2	187.8	0.0	-1.5	-238.8	6.3	-2.7	1.2	-3.3
기관	223.3	-33.1	190.3	-1.7	366.6	51.5	102.9	-1.8	0.8	-31.1
금융투자	204.4	14.6	219.0	-1.6	231.7	-88.1	103.5	0.0	0.5	9.1
투신	62.5	-8.6	54.0	0.0	19.2	220.7	0.9	-1.5	0.0	17.3
은행+보험+기타금융	60.6	-24.8	35.8	0.0	73.0	-14.8	-1.6	-0.3	0.2	-0.8
연기금+국가자재	-70.8	-12.2	-82.9	-0.1	8.0	-66.3	0.0	0.0	0.0	-56.7
기타법인	43.8	0.8	44.7	0.0	0.0	32.7	-2.9	-0.8	-0.6	1.6

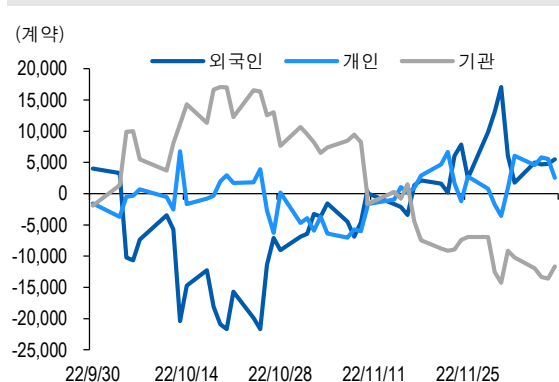
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



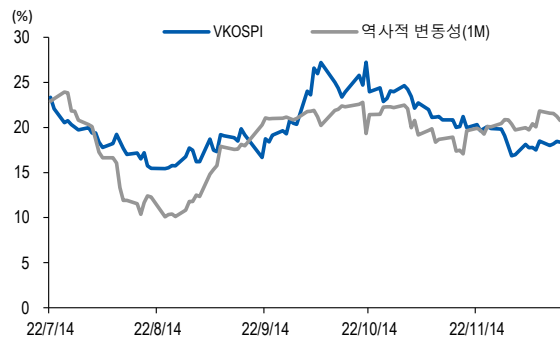
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,116,411	294.7	491,425	7.0%	지수옵션 전체	4,049,957	645.7	1,299,487
Put	1,933,546	351.0	808,062	13.7%	PCR(금액기준)	1.19	VKOSPI	18.38%(-0.07%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	315.0(K+3)	0.01	-0.02	32,102	0	-51,399	17.8	Put	310.0(K+1)	2.39	-0.06	156,137	0	-30,661	21.0
	312.5(K+2)	0.01	-0.15	146,529	0	-39,091	11.9		307.5(K+0)	0.36	-0.71	676,527	0	-25,951	10.5
	310.0(K+1)	0.02	-0.63	738,305	0	-38,606	6.4		305.0(K-1)	0.07	-0.30	743,694	0	-38,964	13.9
	307.5(K+0)	0.44	-1.35	904,091	0	-13,761	5.8		302.5(K-2)	0.01	-0.11	151,702	0	-47,484	15.9
	305.0(K-1)	2.64	-1.00	144,298	0	-8,825	8.7		300.0(K-3)	0.01	-0.03	24,467	0	-53,325	21.8

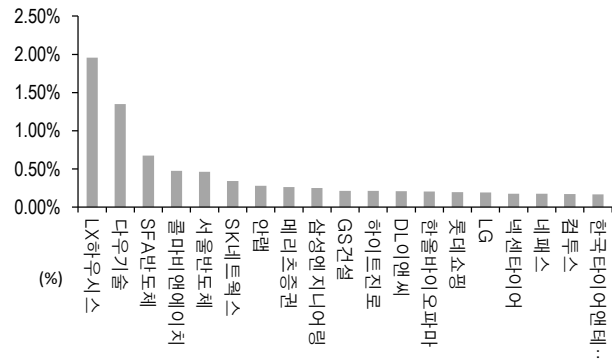
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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	3,825,190	2,434.6	3,340,480	-1,884,140	33,164	18,574	-54,238	32.7	-3.3	-31.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
한화솔루션	47,800	0.00	36.5	61.5	0	-61,496	-0.03%	1,044	-3,427	2,383	3,303	-1,026
에스엠	78,800	-0.63	13.9	43.3	0	-22,348	0.00%	910	160	-1,071	-1,047	0
컴투스	61,300	0.82	5.1	40.5	0	-5,051	0.17%	757	-1,764	1,007	-318	0
NAVER	185,500	0.82	49.0	37.4	0	-38,966	-0.17%	5,148	-7,705	2,714	1,939	770
SK 이노베이션	163,500	-0.30	18.6	33.6	0	-9,544	0.09%	1,223	-43	-1,166	-853	-886
롯데케미칼	190,000	0.53	17.6	30.7	0	-16,319	-0.01%	-2,610	1,285	1,298	-2,338	-417
삼성전자	58,800	-0.34	228.1	30.2	0	-563,010	-0.08%	11,996	-10,512	-5,257	10,463	-10,675
JYP Ent.	63,900	0.79	6.4	28.5	0	-9,237	-0.03%	586	-111	-475	-491	0
삼성전기	134,000	-0.37	15.7	28.1	0	-12,258	-0.22%	769	-1,894	1,150	288	722
일진머티리얼즈	59,600	-0.17	3.0	26.7	0	-20,833	-0.02%	-1,396	175	1,221	1,332	-111

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터