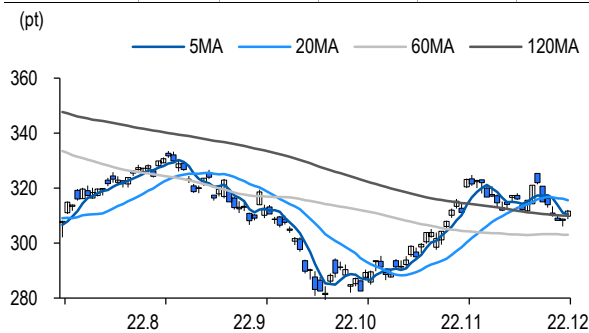


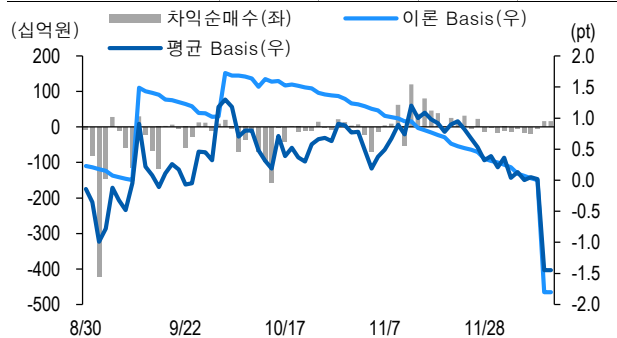
## 선물옵션시장 지표

2022.12.12

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	311.63	1.10	3.39	5,757.6	-
선물 3월물	310.65	1.19	3.65	22,502.5	270,621
선물 6월물	312.40	1.17	3.60	16.6	24,011
1월물(mini)	308.98	1.13	3.44	1,441.0	60,156
2월물(mini)	309.60	1.06	3.24	2.1	13,135



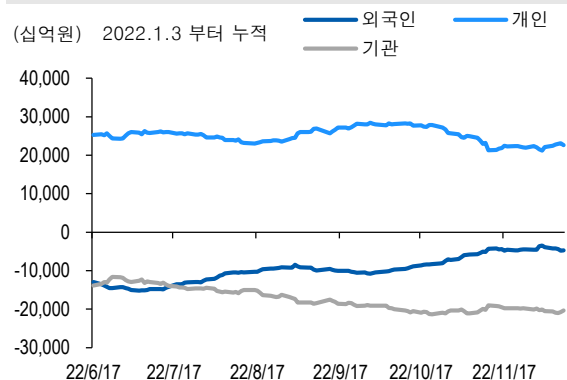
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	-1.80	-1.45	-0.98	0.11%
베이스(mini)	-3.67	-2.97	-2.65	0.22%
제1스프레드(SP)	2.25	1.79	1.80	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	-3.67	-2.50	-2.50	0.37%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	98.5	14.1	112.6	8.3	82.0	-220.5	-2.0	3.5	-6.0	36.0
개인	-508.6	-4.2	-512.8	0.0	0.3	-106.5	0.5	-2.3	-2.2	32.1
기관	407.6	-10.3	397.3	8.4	-14.7	389.0	1.6	-1.0	8.3	-69.8
금융투자	404.2	-32.1	372.1	5.3	3.7	-61.2	1.0	-0.9	8.7	-29.9
투신	-26.5	3.3	-23.2	0.0	-18.0	496.9	1.5	-0.1	-0.3	-7.3
은행+보험+기타금융	-10.7	15.4	4.7	0.0	2.2	-55.1	-0.9	0.0	0.0	0.5
연기금+국가자재	22.3	0.0	22.3	1.6	-6.6	8.3	0.0	0.0	0.0	-33.1
기타법인	2.5	0.4	2.9	0.0	0.7	-61.9	-0.1	-0.2	-0.1	1.8

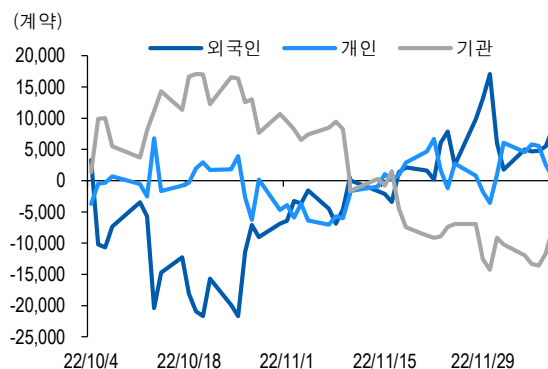
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

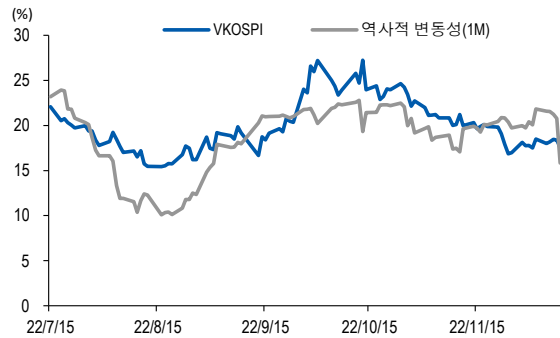
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	517,970	199.1	557,857	17.2%	지수옵션 전체	976,286	390.8	1,434,725
Put	458,316	191.7	876,868	16.1%	PCR(금액기준)	0.96	VKOSPI	17.57%(-0.81%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	315.0(K+3)	3.63	0.88	38,299	11,221	2,776	17.1	Put	310.0(K+1)	6.64	-2.34	7,401	5,737	780	14.6
	312.5(K+2)	4.61	1.08	17,256	5,373	1,570	17.4		307.5(K+0)	5.46	-2.00	9,184	4,042	620	15.0
	310.0(K+1)	5.78	1.37	12,225	6,786	1,517	17.7		305.0(K-1)	4.60	-1.64	12,031	8,025	305	15.8
	307.5(K+0)	7.09	1.54	9,192	4,328	1,553	18.1		302.5(K-2)	3.73	-1.47	9,558	3,602	134	16.2
	305.0(K-1)	8.59	2.02	2,789	4,650	468	18.6		300.0(K-3)	3.01	-1.28	24,387	12,481	2,057	16.5

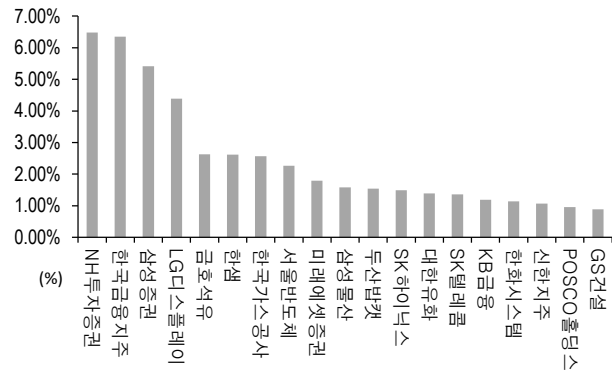
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	3,213,432	2,009.5	3,767,476	426,996	95,201	75,051	-173,746	36.0	32.1	-69.8	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,100	2.04	535.5	85.3	1,026,169	44,158	-0.01%	18,786	15,777	-36,037	-31,429	-11,007
삼성전기	136,000	1.49	30.5	68.6	11,934	3,054	-0.45%	-973	-680	1,645	2,111	-763
일진머티리얼즈	57,500	-3.69	8.4	62.6	42,947	-735	-0.09%	285	-1,439	1,156	1,156	0
메리츠증권	5,640	-0.53	5.3	60.8	86,921	4,616	-0.07%	-4,615	1,296	3,319	3,319	0
LG 이노텍	285,500	1.24	36.3	58.5	13,233	3,509	0.29%	-1,352	3,402	-2,038	-1,551	-487
호텔신라	79,400	1.15	16.6	51.7	14,258	3,959	-0.22%	1,194	-1,342	148	251	-103
현대제철	32,300	5.90	10.0	51.3	14,425	5,122	0.09%	-1,776	2,897	-1,166	-453	-713
대한유화	168,000	1.20	5.1	51.0	1,896	519	1.39%	-361	-155	515	515	0
한국조선해양	74,000	1.51	5.1	50.4	2,883	756	-0.16%	-551	47	506	742	-236
한국금융지주	56,200	1.81	3.8	50.1	24,069	942	6.35%	-211	-22	233	379	-146

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터