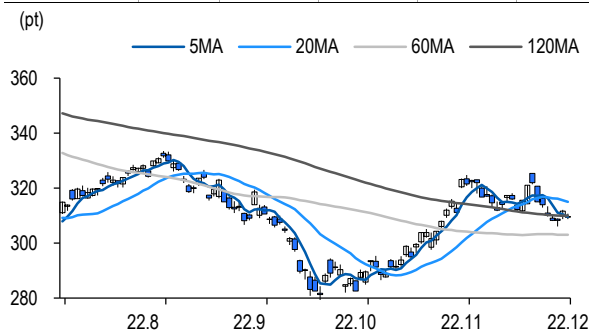


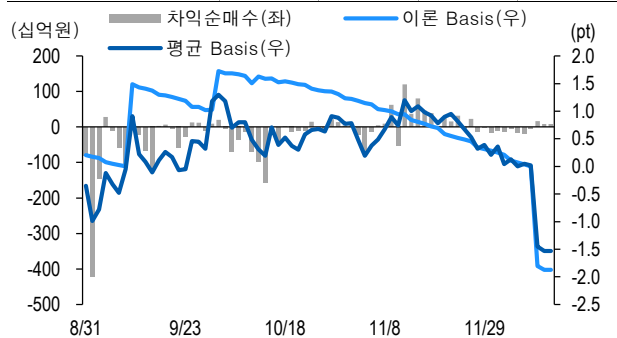
선물옵션시장 지표

2022.12.13

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	309.64	-0.64	-1.99	4,030.9	-
선물 3월물	308.05	-0.84	-2.60	17,373.0	269,785
선물 6월물	309.60	-0.90	-2.80	19.4	23,998
1월물(mini)	306.46	-0.82	-2.52	1,001.0	63,363
2월물(mini)	307.96	-0.53	-1.64	1.2	13,158



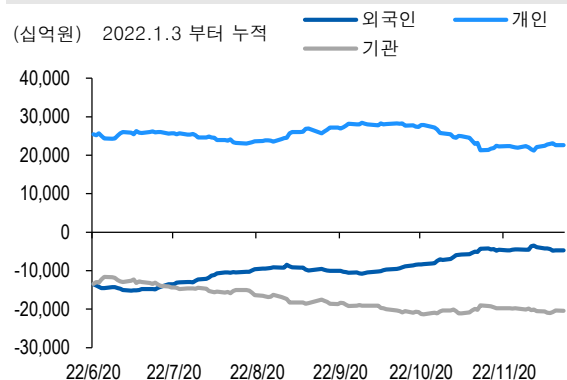
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	-1.88	-1.53	-1.59	0.11%
베이스(mini)	-3.73	-3.14	-3.18	0.19%
제1스프레드(SP)	2.24	1.80	1.80	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	-3.73	-3.07	-3.07	0.21%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	17.7	7.8	25.6	2.8	58.1	0.4	-2.4	-0.8	1.8	-9.4
개인	-0.7	17.3	16.6	0.0	0.1	188.9	-1.7	-0.4	0.5	7.0
기관	-44.0	-22.7	-66.7	5.2	-8.4	-251.5	4.0	1.0	-2.4	1.4
금융투자	24.4	-39.7	-15.3	5.3	6.9	50.1	3.6	1.1	-2.8	-1.0
투신	2.8	5.4	8.1	0.0	-9.4	-286.1	-0.1	-0.1	0.0	4.2
은행+보험+기타금융	-11.3	9.7	-1.7	0.0	4.0	9.3	0.5	0.0	0.4	0.5
연기금+국가지자체	-13.4	-4.4	-17.8	0.0	-10.8	-24.8	0.0	0.0	0.0	-2.2
기타법인	26.9	-2.4	24.5	0.0	-0.2	62.2	0.1	0.1	0.1	0.9

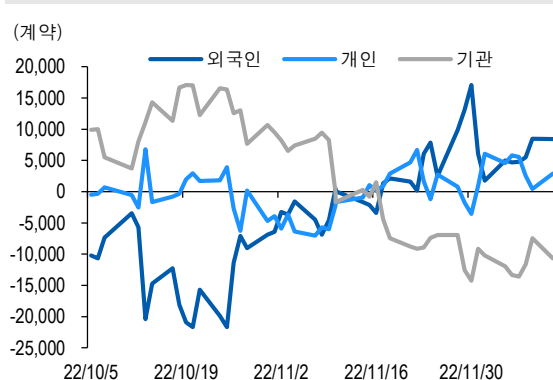
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	367,349	130.9	578,630	17.0%	지수옵션 전체	714,685	286.1	1,503,182
Put	347,336	155.2	924,552	16.6%	PCR(금액기준)	1.19	VKOSPI	18.52%(+0.95%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	1.55	-0.59	47,389	15,482	2,169	16.8	Put	315.0(K+1)	11.25	1.53	254	2,120	54	15.3
	317.5(K+2)	2.11	-0.71	38,016	10,387	716	17.1		312.5(K+0)	9.56	1.40	1,607	3,044	184	15.6
	315.0(K+1)	2.80	-0.83	26,857	12,673	1,452	17.3		310.0(K-1)	8.22	1.58	4,658	5,820	83	16.5
	312.5(K+0)	3.63	-0.98	14,744	6,737	1,364	17.5		307.5(K-2)	6.77	1.31	6,378	4,653	611	16.5
	310.0(K-1)	4.61	-1.17	10,438	7,795	1,009	17.8		305.0(K-3)	5.59	0.99	8,127	8,809	784	16.8

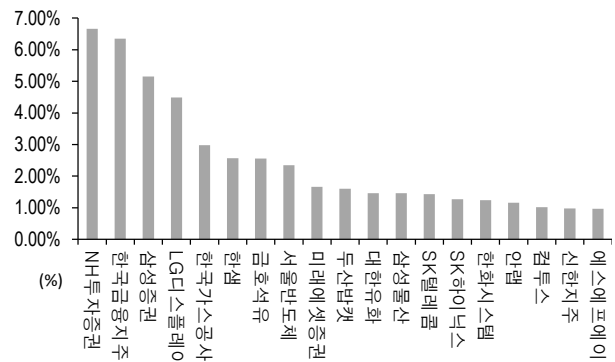
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,566,987	1,479.2	3,896,848	129,372	-56,826	8,199	46,848	-9.4	7.0	1.4		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	59,400	-1.16	446.3	83.1	1,027,627	1,458	0.00%	-13,353	-13,327	24,774	25,796	601
NAVER	193,500	-1.28	92.4	73.4	31,637	102	0.04%	-1,205	1,097	108	1,164	-1,056
LG 이노텍	281,500	-1.40	28.1	73.3	15,675	2,442	0.34%	-591	2,356	-1,776	-2,005	229
두산에너지	16,050	-0.31	28.1	69.9	62,526	7,003	-0.17%	9,168	2,467	-11,651	-7,251	-4,400
SK 하이닉스	81,200	0.00	65.9	66.4	174,808	3,268	1.27%	-3,108	-3,059	6,408	4,856	230
일진머티리얼즈	57,900	0.70	5.6	61.0	42,591	-356	-0.08%	-68	13	55	236	-181
현대제철	31,550	-2.32	8.9	56.2	14,082	-343	0.13%	41	489	-530	-1,196	666
메리츠증권	5,700	1.06	4.9	55.8	99,075	12,154	0.09%	2,554	8,050	-10,604	-10,544	-60
호텔신라	77,700	-2.14	11.3	54.5	13,958	-300	-0.10%	-973	193	780	967	-187
삼성전기	135,500	-0.37	19.8	54.2	12,677	743	-0.44%	-1,002	-24	1,026	1,101	-75

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터