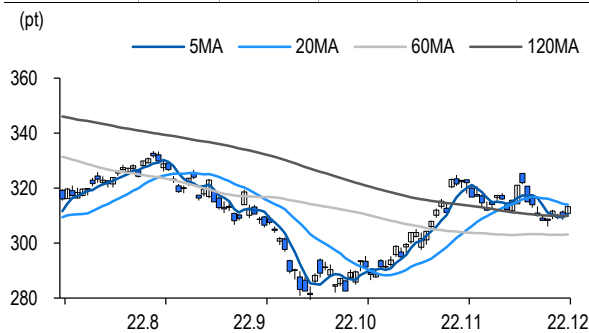


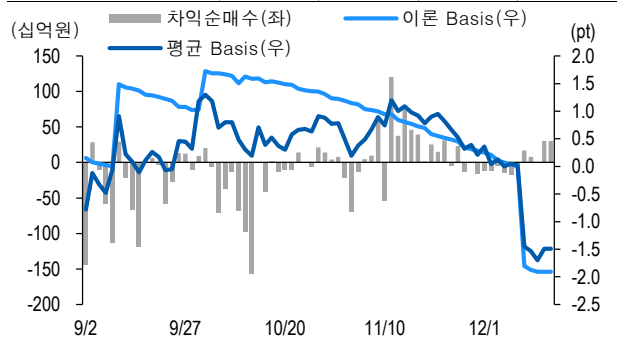
## 선물옵션시장 지표

2022.12.15

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(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



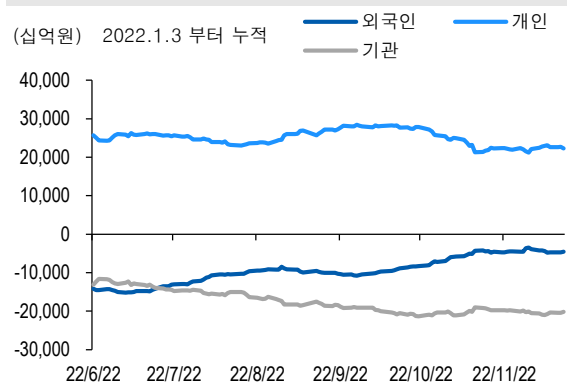
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	-1.91	-1.49	-1.83	0.13%
베이스(mini)	-3.79	-3.08	-3.39	0.23%
제1스프레드(SP)	2.28	1.89	1.80	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	-3.79	-3.39	-3.39	0.13%



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+국가자재	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

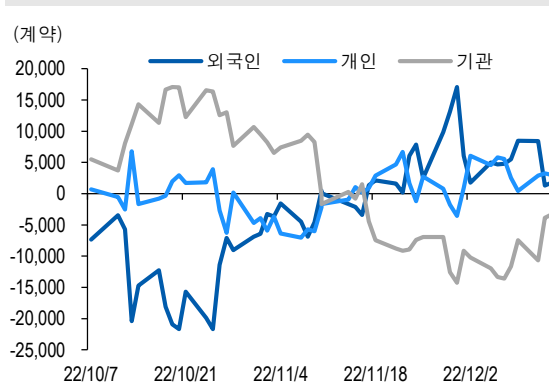
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

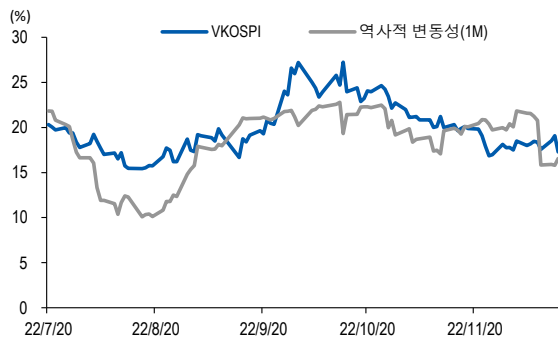
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	403,866	140.5	625,063	15.8%	지수옵션 전체	855,074	268.7	1,645,974
Put	451,208	128.2	1,020,911	16.2%	PCR(금액기준)	0.91	VKOSPI	17.27%(-1.82%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		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

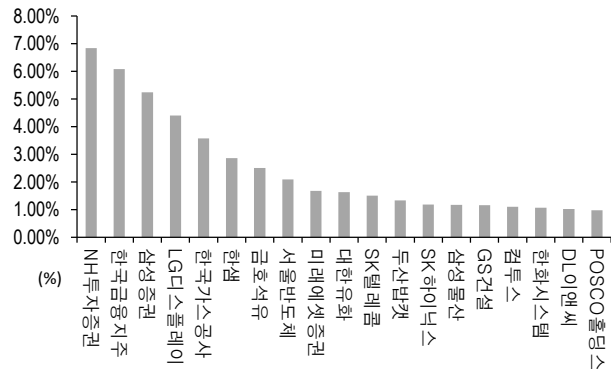
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	2,037,764	1,351.5	4,095,434	98,571	20,421	-23,839	1,639	25.5	-8.8	-17.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,400	1.00	329.4	67.9	1,065,706	13,318	0.04%	13,515	-14,135	1,172	-4,437	6,389
메리츠증권	5,690	0.18	3.4	59.1	107,042	-854	0.38%	84	-649	565	565	0
현대차	161,000	2.88	58.7	58.7	35,403	4,621	0.18%	5,569	1,571	-7,141	-6,387	-754
NAVER	194,000	0.00	76.6	58.1	32,441	2,430	0.11%	88	90	-212	547	-1,059
롯데케미칼	168,500	-1.75	21.0	56.2	17,598	3,194	0.20%	571	-165	-457	2,509	-85
카카오	58,700	0.69	45.7	50.4	46,750	3,974	-0.19%	-4,595	965	3,140	3,108	30
일진머티리얼즈	59,400	6.64	8.0	49.1	42,249	1,339	0.24%	3,865	-210	-3,655	-2,868	-787
NH 투자증권	9,220	0.88	1.6	49.0	10,852	1,585	6.84%	59	3	-62	-62	0
현대제철	32,150	0.16	4.0	48.8	20,306	-598	-0.01%	-1,532	91	1,441	1,226	215
삼성 SDI	670,000	3.72	70.0	47.7	14,065	277	0.12%	915	-538	-362	-317	-17

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터