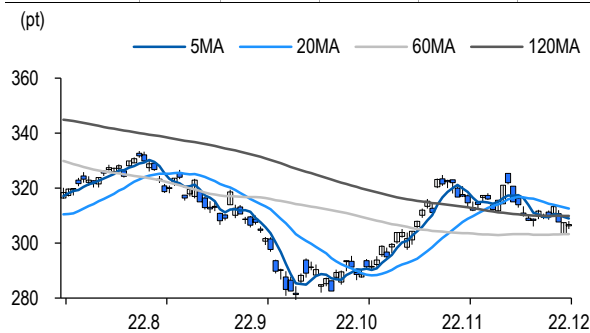


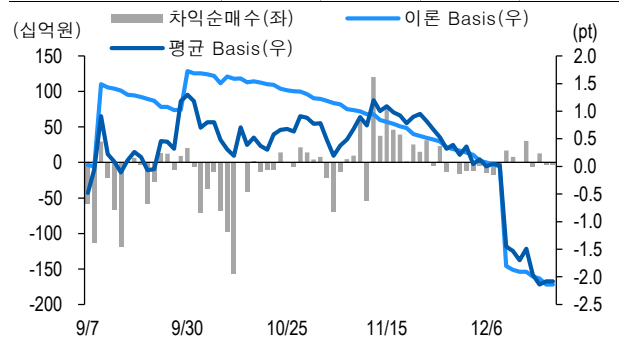
선물옵션시장 지표

2022.12.20

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(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



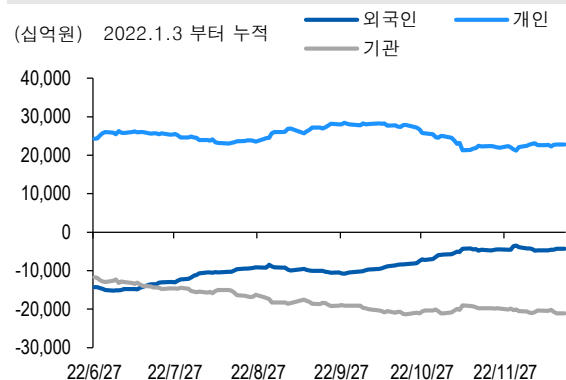
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	-2.14	-2.08	-2.42	0.02%
베이스(mini)	-3.98	-3.58	-3.89	0.13%
제1스프레드(SP)	2.21	1.85	1.80	-0.12%
합성선물 베이스(ATM)	-3.98	-3.85	-3.85	0.04%



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

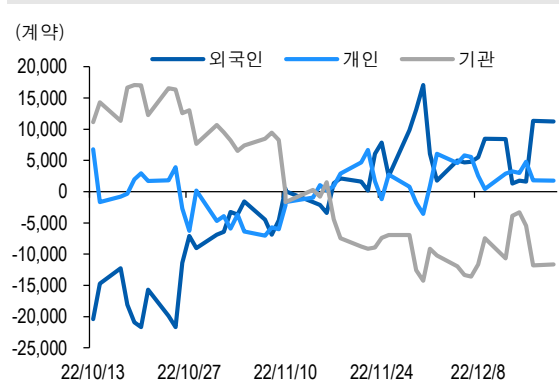
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



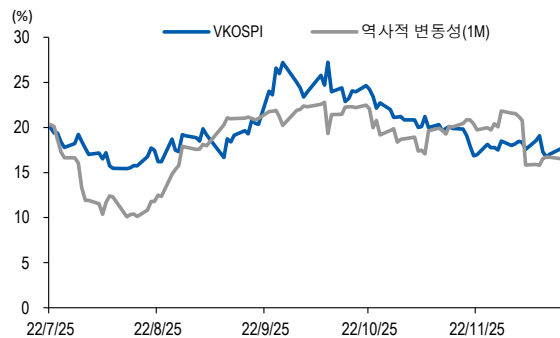
선물옵션시장 지표

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	1,855,164
Put	367,454	115.1	1,164,190	16.2%	PCR(금액기준)	0.98	VKOSPI	17.60%(+0.57%p)

	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

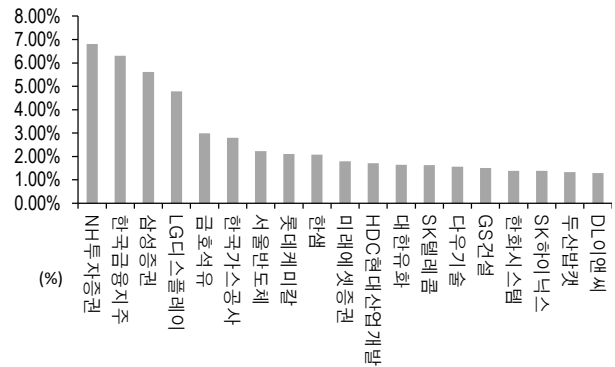
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,000,647	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
한올바이오파마	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
일진머티리얼즈	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 리서치센터