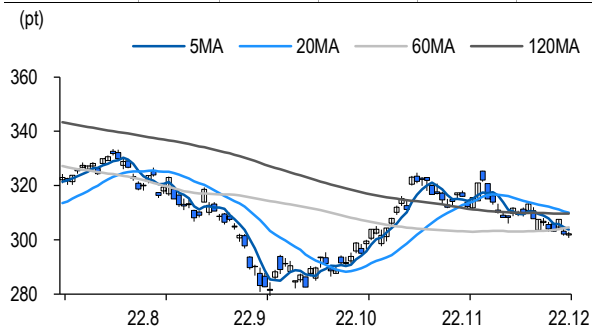


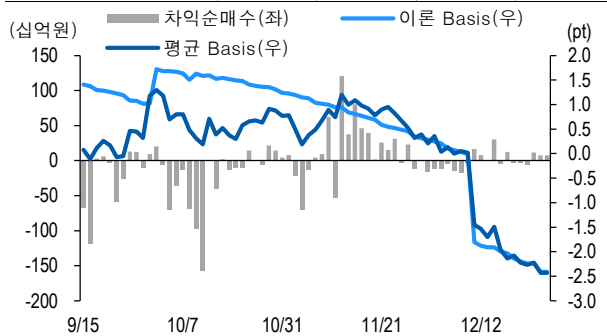
## 선물옵션시장 지표

2022.12.27

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	302.27	0.07	0.20	3,297.9	-
선물 3월물	299.95	0.17	0.50	9,530.5	281,938
선물 6월물	302.10	0.35	1.05	5.7	24,524
1월물(mini)	298.44	0.18	0.54	810.9	88,049
2월물(mini)	299.32	0.25	0.74	3.4	13,852



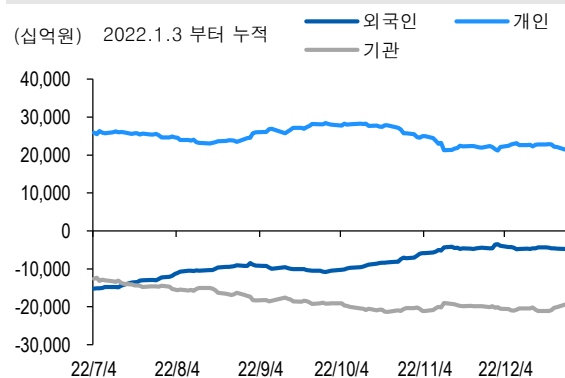
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-2.41	-2.43	-2.32	-0.01%
베이스(mini)	-4.23	-4.01	-3.83	0.07%
제1스프레드(SP)	2.17	1.85	1.80	-0.11%
합성선물 베이스(ATM)	-4.23	-3.86	-3.86	0.12%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-42.2	-17.6	-59.8	-1.8	-11.3	427.5	-88.9	-3.1	3.1	-7.4
개인	-620.1	20.0	-600.1	0.0	-4.1	-156.0	-11.4	-0.4	0.6	12.5
기관	660.6	-4.6	656.0	9.2	83.3	-229.3	100.8	3.9	-3.8	-5.8
금융투자	473.3	-73.7	399.6	13.6	-10.0	-335.1	101.6	4.0	-3.7	-58.2
투신	26.5	6.6	33.1	6.0	7.1	197.1	0.6	-0.1	0.0	51.8
은행+보험+기타금융	97.9	71.9	169.8	0.0	68.6	-102.5	-1.5	0.0	0.0	0.5
연기금+국가자재	-17.8	-33.4	-51.2	-10.4	13.7	11.2	0.0	0.0	0.0	0.0
기타법인	1.7	2.3	4.0	0.0	1.1	-42.3	-0.6	-0.3	0.1	0.7

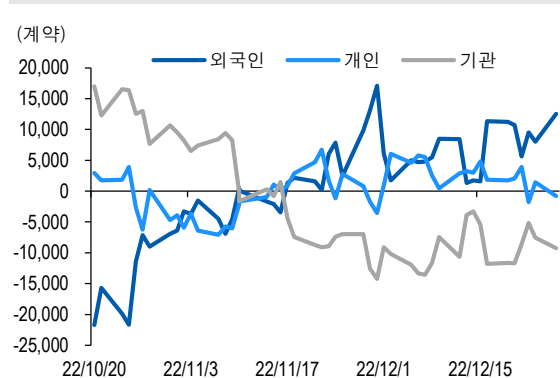
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

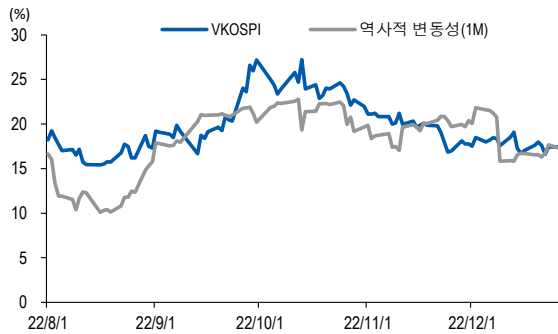
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	319,194	80.6	800,352	14.9%	지수옵션 전체	613,483	190.8	2,055,958
Put	294,289	110.2	1,255,606	15.2%	PCR(금액기준)	1.37	VKOSPI	17.46%(+0.03%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	310.0(K+3)	0.57	-0.11	48,695	21,071	1,745	14.8	Put	305.0(K+1)	8.00	-0.69	663	10,251	26	13.1
	307.5(K+2)	0.90	-0.15	49,773	14,554	1,180	14.7		302.5(K+0)	6.32	-0.66	4,234	9,544	248	13.9
	305.0(K+1)	1.47	-0.15	43,431	17,266	631	15.1		300.0(K-1)	4.88	-0.60	5,789	16,128	541	14.5
	302.5(K+0)	2.23	-0.16	34,085	13,850	2,739	15.3		297.5(K-2)	3.64	-0.59	11,343	12,202	-2,034	14.9
	300.0(K-1)	3.26	-0.16	15,500	9,269	1,610	15.7		295.0(K-3)	2.68	-0.52	26,100	19,738	-1,150	15.3

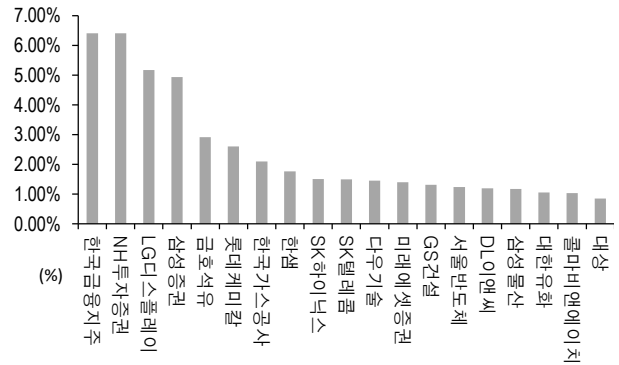
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	1,862,932	1,055.6	4,482,172	82,771	-39,398	57,407	-20,515	-7.4	12.5	-5.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	6,550	-2.24	0.6	167.3	4,014	591	-1.54%	-651	351	300	300	0
아모레퍼시픽	132,000	-0.38	21.5	92.5	13,635	-72	-0.03%	-187	-1,589	1,790	-146	-69
카카오	53,600	0.75	37.0	70.2	63,679	427	0.04%	-262	-1,092	1,303	-1,121	2,098
일진머티리얼즈	51,900	-0.76	6.0	65.7	36,298	-1,075	-0.20%	3,059	-3,345	279	327	-48
현대제철	31,850	0.95	5.2	65.4	45,940	6,389	0.34%	-3,037	7,240	-4,203	-3,311	-892
CJ ENM	101,800	-0.39	8.9	63.2	8,912	2,570	0.21%	-273	157	116	-2,330	0
롯데케미칼	180,500	2.85	12.1	62.3	22,893	-79	2.60%	-871	-494	1,367	-49	135
LG 화학	613,000	0.99	37.1	61.2	9,852	662	0.56%	-713	690	23	-440	394
LG 전자	88,600	-1.01	25.0	60.2	36,679	-4,833	-0.42%	-2,009	492	1,579	-794	-1,545
삼성전자	57,600	-0.69	233.4	59.7	1,058,220	4,807	0.05%	-2,203	-7,740	9,935	792	-400

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터