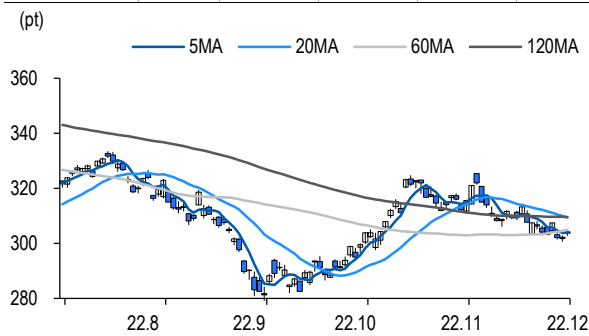


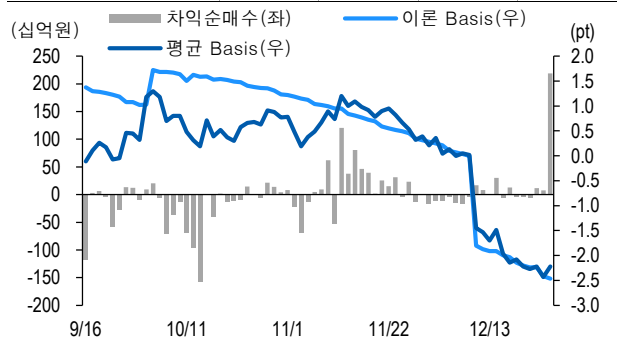
선물옵션시장 지표

2022.12.28

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	304.22	0.65	1.95	4,924.0	-
선물 3월물	302.30	0.78	2.35	16,104.1	285,573
선물 6월물	304.10	0.66	2.00	10.6	24,550
1월물(mini)	300.52	0.70	2.08	1,144.1	98,531
2월물(mini)	301.34	0.67	2.02	7.3	9,303



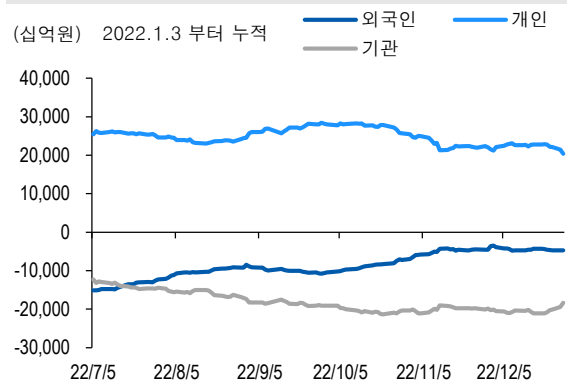
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	-2.46	-2.22	-1.92	0.08%
베이스(mini)	-4.27	-3.87	-3.70	0.13%
제1스프레드(SP)	2.19	1.82	1.85	-0.12%
합성선물 베이스(ATM)	-4.27	-3.65	-3.65	0.20%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	48.2	24.2	72.4	0.7	1.7	453.7	-86.8	-4.6	5.8	4.7
개인	-1,133.0	11.4	-1,121.6	0.0	-33.8	-89.2	41.2	0.2	2.8	46.6
기관	1,097.9	-47.9	1,050.0	218.2	98.7	-321.4	46.3	4.4	-8.7	-52.2
금융투자	942.7	-133.8	808.9	209.6	9.7	-632.1	47.2	4.1	-8.0	-83.3
투신	60.5	19.2	79.7	5.4	45.4	333.1	0.1	0.1	-0.4	31.4
은행+보험+기타금융	84.9	22.7	107.6	8.5	74.0	-53.2	-1.0	0.0	0.0	-2.7
연기금+국가지자체	-66.9	20.9	-46.0	-5.2	-34.4	30.8	0.0	0.1	-0.3	2.4
기타법인	-13.1	12.3	-0.8	0.0	-6.5	-43.1	-0.7	0.0	0.1	0.9

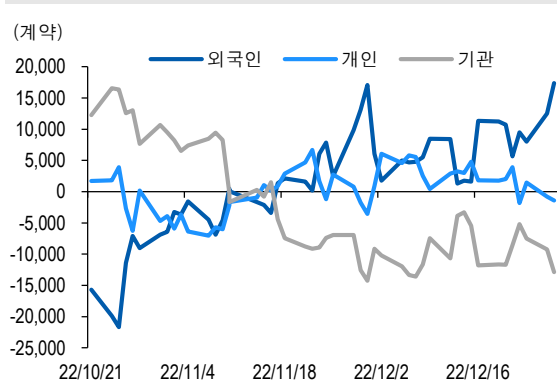
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



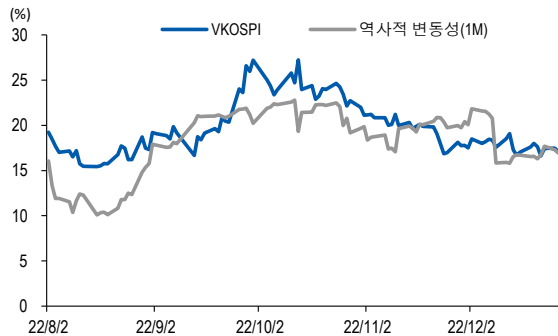
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	436,396	123.9	829,923	15.0%	지수옵션 전체	864,712	250.9	2,108,820
Put	428,316	127.0	1,278,897	14.9%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	17.09%(-0.37%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	310.0(K+3)	0.74	0.17	77,670	25,439	4,368	14.6	Put	305.0(K+1)	6.38	-1.62	2,528	10,230	-21	12.6
	307.5(K+2)	1.23	0.33	73,062	17,021	2,467	14.9		302.5(K+0)	4.86	-1.46	10,411	12,332	2,788	13.3
	305.0(K+1)	1.97	0.50	61,011	17,405	139	15.3		300.0(K-1)	3.65	-1.23	17,268	19,143	3,015	14.1
	302.5(K+0)	2.93	0.70	41,843	17,608	3,758	15.7		297.5(K-2)	2.66	-0.98	20,619	13,222	1,020	14.7
	300.0(K-1)	4.19	0.93	15,366	10,484	1,215	16.3		295.0(K-3)	1.89	-0.79	41,325	21,072	1,334	15.2

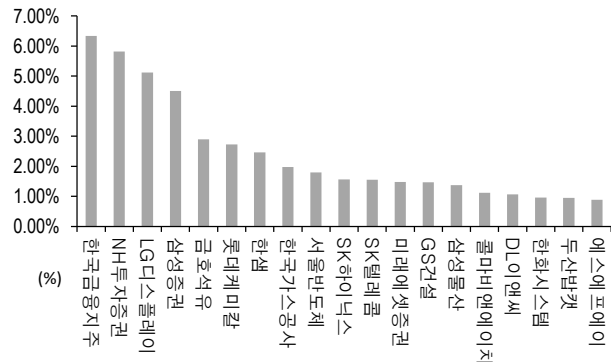
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,274,575	1,286.1	4,624,977	142,805	64,884	104,311	-169,646	4.7	46.6	-52.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	6,700	2.29	0.4	89.5	2,995	-1,019	-1.50%	799	432	-1,231	-1,231	0
일진머티리얼즈	54,400	4.82	8.8	62.7	33,934	-2,364	-0.21%	2,111	-3,022	911	889	22
롯데케미칼	181,500	0.55	10.5	60.4	21,517	-1,376	2.73%	-869	-520	1,386	-317	40
LG 전자	89,000	0.45	27.0	54.7	29,492	-7,187	-0.20%	0	9,566	-9,566	-6,039	-65
삼성전자	58,100	0.87	327.4	52.9	1,077,733	19,513	0.09%	-11,655	27,309	-15,695	-18,076	600
NAVER	181,000	0.84	43.7	49.5	26,193	1,205	0.05%	-230	1,490	-1,262	-1,136	-126
카카오	54,500	1.68	32.2	48.6	62,429	-1,250	-0.07%	-2,695	652	1,986	-3,220	5,206
아모레퍼시픽	139,500	5.68	29.4	48.4	11,030	-2,605	-0.10%	1,779	22	-1,761	-3,068	234
LG 이노텍	268,500	-0.37	29.1	47.4	19,323	-3,346	0.00%	-87	-3,335	3,363	3,099	203
삼성 SDI	626,000	-0.16	50.9	45.7	17,505	892	0.25%	-192	313	-141	-699	47

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터