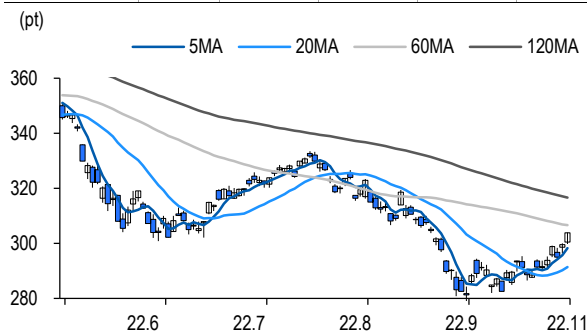


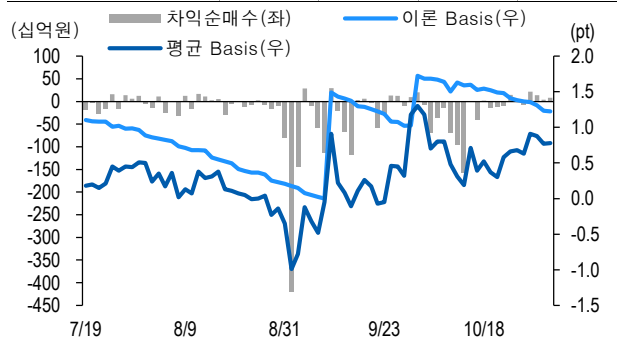
선물옵션시장 지표

2022.11.2

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	303.88	1.44	4.30	6,940.4	-
선물 12월물	303.90	1.06	3.20	20,477.6	338,199
선물 3월물	301.95	1.16	3.45	43.4	19,537
11월물(mini)	303.60	1.13	3.40	1,223.4	76,538
12월물(mini)	304.30	1.20	3.70	10.2	7,074



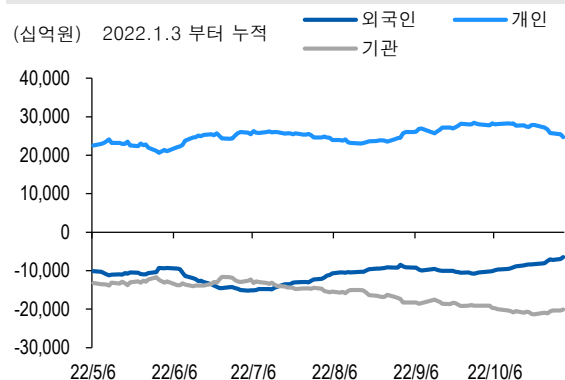
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.22	0.78	0.02	-0.15%
베이스(mini)	0.30	0.27	-0.28	-0.01%
제1스프레드(SP)	-1.87	-2.27	-2.30	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.30	-0.35	-0.35	-0.21%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	492.7	-7.7	485.0	4.3	414.9	-54.1	89.7	-9.8	-1.7	-3.3
개인	-723.6	-32.7	-756.3	0.0	1.4	73.7	-15.3	9.5	-4.5	14.3
기관	194.2	21.3	215.5	3.6	-25.2	-16.9	-71.9	-1.2	7.3	-12.8
금융투자	135.4	147.6	283.0	3.7	-1.8	-190.6	-70.7	-2.3	5.1	-26.2
투신	32.1	-19.7	12.4	0.0	8.1	165.5	-1.1	1.1	0.0	14.1
은행+보험+기타금융	4.7	-90.7	-86.0	0.0	-18.7	-2.0	0.0	0.0	2.2	-0.5
연기금+국가지자체	5.3	-15.1	-9.8	0.0	-10.6	10.2	0.0	0.0	0.0	-0.1
기타법인	36.6	19.1	55.8	0.0	0.4	-2.7	-2.6	1.4	-1.2	1.7

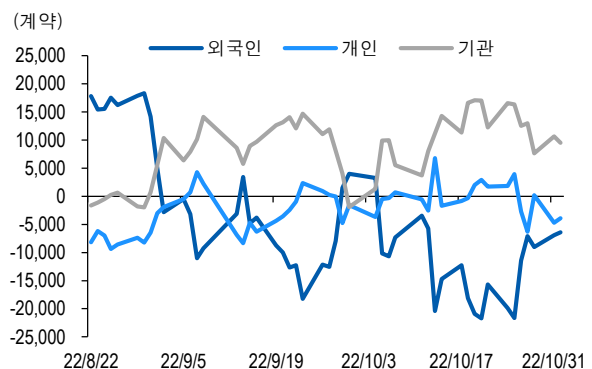
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



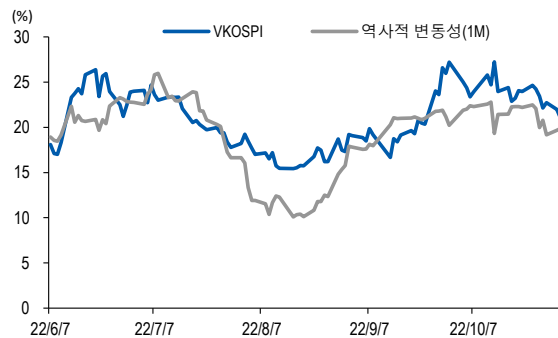
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,066,539	330.3	1,133,715	17.5%	지수옵션 전체	2,183,811	552.9	2,930,450
Put	1,117,272	222.6	1,796,735	21.8%	PCR(금액기준)	0.67	VKOSPI	21.11%(-0.86%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	307.5(K+3)	2.17	0.81	135,622	25,411	1,763	17.7	Put	302.5(K+1)	3.42	-1.95	21,801	5,182	4,076	21.1
	305.0(K+2)	3.12	1.02	92,582	31,475	-347	17.4		300.0(K+0)	2.47	-1.65	48,087	17,599	3,972	21.3
	302.5(K+1)	4.44	1.34	41,375	28,232	-900	17.6		297.5(K-1)	1.72	-1.36	65,464	14,286	6,795	21.5
	300.0(K+0)	6.00	1.67	22,269	31,077	-1,310	17.6		295.0(K-2)	1.17	-1.08	81,835	20,476	5,744	21.7
	297.5(K-1)	7.68	1.87	3,279	16,302	-387	16.6		292.5(K-3)	0.79	-0.86	91,012	20,559	5,990	22.1

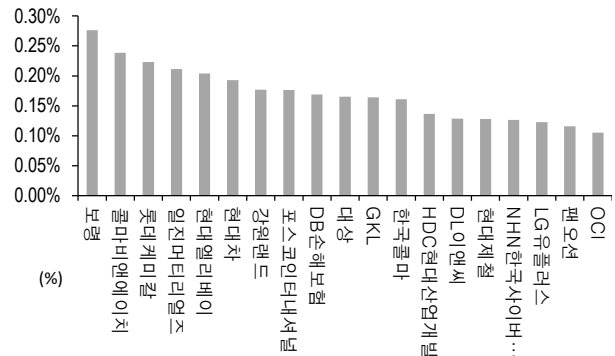
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,655,766	2,560.7	4,857,636	31,338	74,810	-23,487	-54,382	-3.3	14.3	-12.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	62,200	2.30	14.8	76.0	49,069	5,767	0.21%	462	4,885	-5,346	-4,269	-1,077
삼성전기	120,500	0.00	45.9	75.7	38,997	2,120	-0.03%	-107	626	-358	1,563	-366
현대차	164,500	0.30	75.1	73.6	44,085	114	0.19%	178	2,254	-2,431	-2,505	-181
삼성전자	60,000	0.84	696.3	68.2	1,239,962	-11,907	-0.16%	-13,615	-18,691	27,936	30,581	-900
한국금융지주	49,650	0.00	6.2	66.1	23,312	1,250	-0.02%	1,851	-92	-1,759	-719	-1
GS 건설	22,750	4.84	16.7	61.1	49,793	5,177	0.05%	7,022	-1,110	-5,712	-11,462	-1,247
엔씨소프트	387,000	-0.26	13.2	61.1	4,784	-107	-0.10%	-99	78	30	81	-51
대한항공	23,450	3.08	14.3	58.7	90,774	-3,968	0.04%	-142	4,000	-2,985	-3,129	-2,656
SK 하이닉스	83,900	1.33	176.1	57.1	179,546	-9,843	0.05%	7,269	1,708	-10,231	-18,622	971
영원무역	47,200	0.00	1.9	56.5	3,274	470	0.10%	70	50	-120	-98	-22

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터