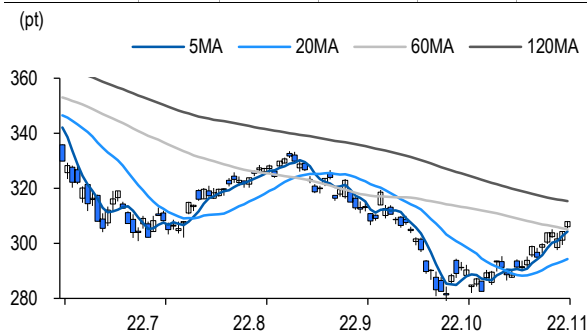


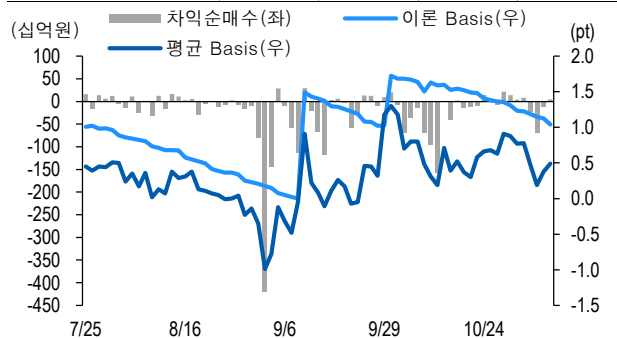
선물옵션시장 지표

2022.11.8

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	307.87	1.16	3.54	6,106.8	-
선물 12월물	309.00	1.18	3.60	24,772.4	340,216
선물 3월물	306.65	1.14	3.45	95.9	19,570
11월물(mini)	308.54	1.13	3.44	1,544.4	70,834
12월물(mini)	308.78	1.11	3.40	25.5	8,468



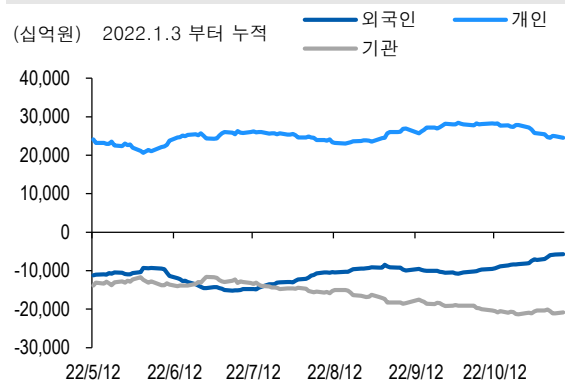
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.04	0.49	1.13	-0.18%
베이스스(mini)	0.10	0.18	0.67	0.03%
제1스프레드(SP)	-1.83	-2.22	-2.25	-0.13%
합성선물 베이스스(ATM)	0.10	0.58	0.58	0.16%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	112.2	20.2	132.4	8.0	87.1	-143.8	-83.3	-4.3	-4.0	25.9
개인	-405.8	-31.3	-437.1	0.0	0.8	-96.6	45.2	4.6	-0.5	-23.3
기관	276.7	16.9	293.6	-3.5	-38.9	45.9	37.8	0.2	5.1	-2.3
금융투자	254.0	49.1	303.1	-1.9	5.2	-77.9	38.2	-0.9	4.5	-40.7
투신	50.8	-9.8	41.0	0.0	-6.0	50.8	-0.4	0.9	0.0	32.0
은행+보험+기타금융	-1.2	-21.6	-22.7	0.0	-12.9	72.5	0.0	0.1	0.6	-0.4
연기금+국가자재	-57.0	0.4	-56.5	0.0	-22.4	0.5	0.0	0.0	0.0	6.8
기타법인	16.9	-5.7	11.1	0.0	-0.1	194.5	0.3	-0.4	-0.6	-0.4

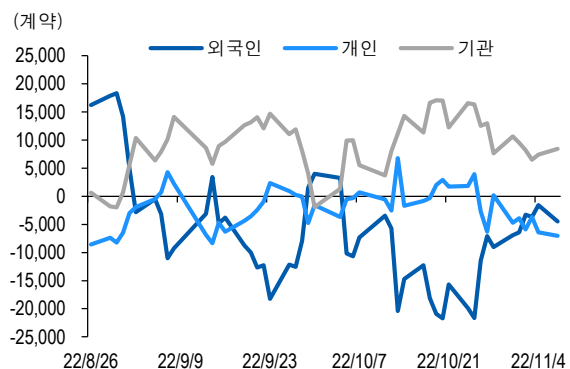
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



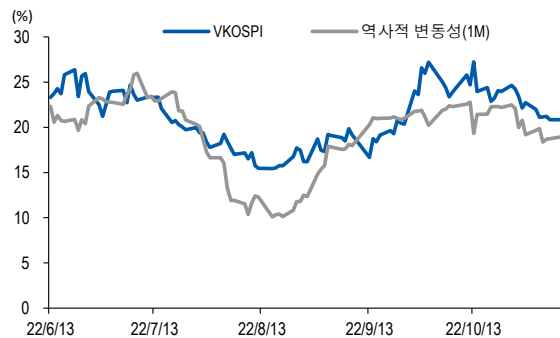
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	2,141,633	527.7	1,225,525	20.4%	지수옵션 전체	4,136,826	910.5	3,317,322			
Put	1,995,193	382.8	2,091,797	21.0%	PCR(금액기준)	0.73	VKOSPI	20.82%(-0.02%p)			

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	312.5(K+3)	0.92	0.24	349,632	40,596	1,478	19.8	Put	307.5(K+1)	2.14	-2.35	107,533	10,799	8,952	18.6
	310.0(K+2)	1.81	0.55	356,703	40,442	-3,681	20.9		305.0(K+0)	1.25	-1.89	199,377	18,777	10,261	19.3
	307.5(K+1)	3.05	0.94	188,398	27,055	-4,613	21.7		302.5(K-1)	0.71	-1.41	239,461	22,105	5,527	20.2
	305.0(K+0)	4.70	1.42	72,394	29,721	-5,238	23.1		300.0(K-2)	0.38	-0.97	298,069	31,769	11,121	21.1
	302.5(K-1)	6.71	1.96	15,315	25,521	-4,003	25.5		297.5(K-3)	0.21	-0.58	278,060	25,594	4,738	22.2

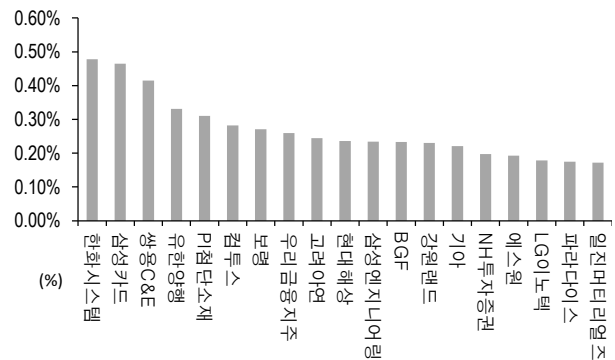
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,974,418	2,746.2	4,882,732	-56,234	77,933	-50,277	-27,215	25.9	-23.3	-2.3		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
코스맥스	50,700	1.40	2.3	82.6	1,954	-319	0.14%	-109	-26	132	132	0
LG 디스플레이	13,400	-1.47	16.4	80.0	174,501	-43,195	0.03%	-6,041	-9,344	15,385	-4,075	1,213
SK 이노베이션	180,500	1.98	71.0	71.7	15,389	-9,416	0.11%	2,638	956	-3,596	-3,709	-1,104
일진머티리얼즈	62,800	0.32	8.6	67.9	50,224	-2,123	0.17%	1,083	-1,026	132	-398	530
LG 화학	702,000	1.74	106.5	67.2	10,212	-877	0.03%	158	-10	-186	-212	26
삼성 SDI	741,000	0.68	115.7	66.3	18,002	-1,674	0.05%	251	-92	-163	-316	249
SK 하이닉스	86,500	2.49	156.1	66.1	157,129	-10,713	-0.02%	4,984	-14,050	9,066	3,476	756
삼성전자	60,000	0.84	482.9	64.8	941,589	-204,390	-0.05%	18,794	-7,577	-11,367	-20,303	8,200
삼성전기	125,500	1.21	40.9	63.0	36,275	-1,348	0.06%	846	-1,653	777	-1,886	-132
현대차	170,000	3.66	110.2	58.3	44,710	953	0.11%	2,057	1,028	-3,015	-4,268	-71

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터