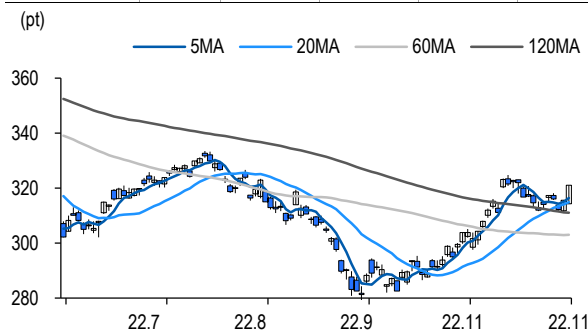


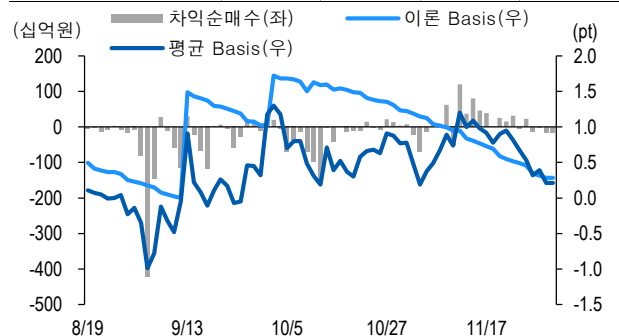
선물옵션시장 지표

2022.12.1

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	321.00	1.72	5.42	8,597.3	-
선물 12월물	319.65	1.25	3.95	22,825.4	298,880
선물 3월물	317.90	1.19	3.75	280.6	30,137
12월물(mini)	319.70	1.27	3.96	1,373.1	49,693
1월물(mini)	316.50	1.20	3.74	11.9	22,779



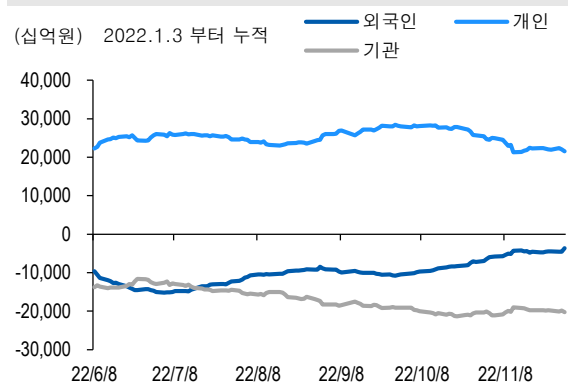
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.28	0.21	-1.35	-0.02%
베이스(mini)	0.28	0.21	-1.30	-0.02%
제1스프레드(SP)	-1.65	-1.59	-1.55	0.02%
합성선물 베이스(ATM)	0.28	-1.29	-1.29	-0.49%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	1,003.7	-45.9	957.7	-1.1	939.3	297.6	16.1	-0.5	-1.0	-27.9
개인	-611.7	98.3	-513.4	0.0	-0.8	-124.9	-17.9	2.0	-1.6	-11.9
기관	-370.6	-53.5	-424.1	-14.9	3.7	-134.5	2.3	-2.6	3.7	41.1
금융투자	-405.9	-98.9	-504.7	-14.8	-5.6	-136.9	2.0	-2.4	3.8	27.1
투신	26.1	9.8	35.8	0.0	-1.9	27.3	0.4	-0.2	0.0	9.0
은행+보험+기타금융	7.2	20.0	27.2	0.0	4.5	-21.0	0.0	0.0	0.0	0.0
연기금+국가자재	-5.8	18.7	12.9	-0.1	10.7	-3.9	0.0	0.0	0.0	4.9
기타법인	-21.4	1.1	-20.3	0.0	0.3	-38.2	-0.6	1.0	-1.1	-1.2

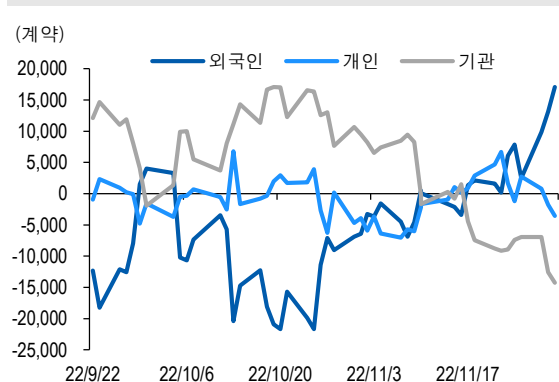
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



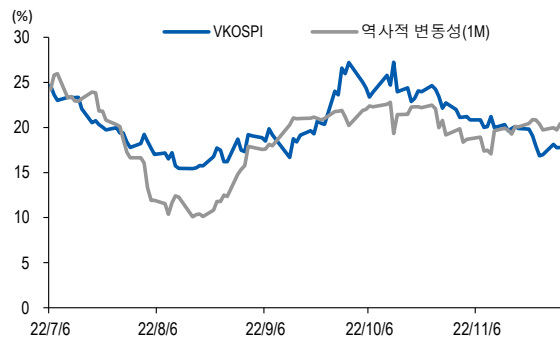
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,252,356	345.0	1,033,771	11.9%	지수옵션 전체	2,441,027	580.6	2,716,717
Put	1,188,671	235.6	1,682,946	20.1%	PCR(금액기준)	0.68	VKOSPI	17.78%(+0.02%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	1.99	1.14	199,813	23,705	-1,270	12.6	Put	317.5(K+1)	2.29	-1.85	47,847	11,804	2,834	19.5
	320.0(K+2)	3.08	1.58	141,581	28,319	-883	11.8		315.0(K+0)	1.48	-1.45	90,695	24,087	3,578	19.3
	317.5(K+1)	4.47	2.02	72,585	15,868	-29	10.1		312.5(K-1)	0.99	-0.99	115,033	22,196	6,779	19.7
	315.0(K+0)	6.19	2.49	33,845	18,440	879	5.9		310.0(K-2)	0.61	-0.71	165,970	35,392	7,033	19.9
	312.5(K-1)	8.04	2.81	3,702	10,901	-109	8.0		307.5(K-3)	0.37	-0.50	140,759	27,845	9,719	20.1

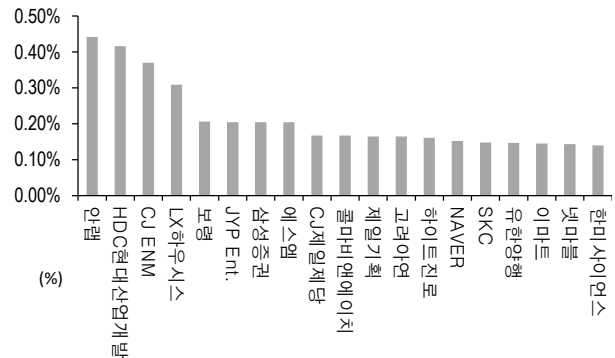
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	3,312,225	1,968.7	5,209,118	110,007	-98,299	-30,914	128,586	-27.9	-11.9	41.1	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	61,700	1.82	529.9	52.4	1,068,418	-37,686	-0.06%	-8,825	-23,681	32,075	25,622	1,700
삼성전기	139,000	3.35	60.1	49.4	14,685	-747	-0.04%	-2,703	429	2,244	1,749	495
일진머티리얼즈	61,800	0.49	6.8	48.1	49,705	215	0.05%	1,117	-148	-969	-848	-117
현대차	169,500	-0.29	34.2	47.2	43,235	-1,055	0.12%	-442	288	159	-145	284
호텔신라	72,900	1.11	7.8	41.0	10,233	-95	-0.08%	-869	-912	1,784	1,778	6
SK 하이닉스	85,100	1.19	111.1	39.9	187,996	-598	0.11%	-1,976	2,497	-618	-3,067	969
LG 전자	97,700	3.83	65.7	39.0	34,957	5,337	0.13%	5,809	3,220	-8,986	-7,054	-1,682
SK 이노베이션	177,000	0.85	31.7	37.2	17,358	-2,817	-0.03%	9	-2,999	2,976	2,338	840
포스코케미칼	218,000	-2.02	67.0	37.2	33,520	484	-0.03%	-191	-383	723	1,025	-620
롯데케미칼	183,000	-0.54	8.5	37.1	22,817	-903	-0.02%	-634	320	319	64	311

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터