

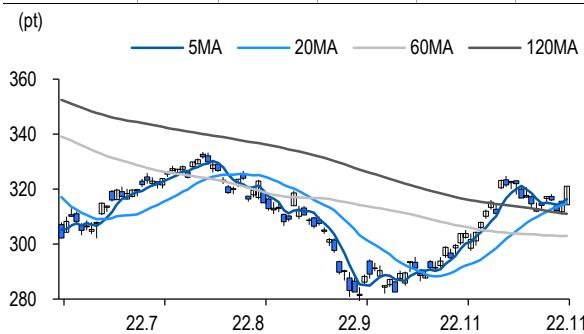


## 선물옵션시장 지표

2022.12.1

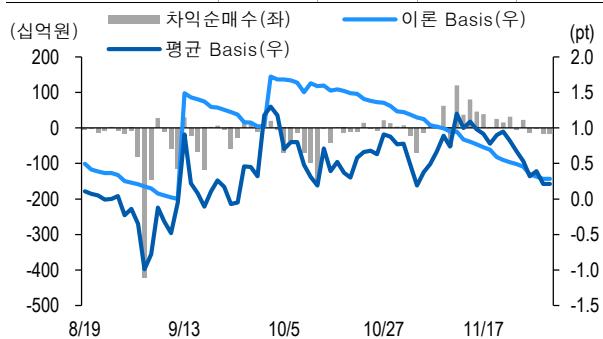
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(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	괴리율(%)
K200 베이시스	0.28	0.21	-1.35	-0.02%
베이시스(mini)	0.28	0.21	-1.30	-0.02%
제1스프레드(SP)	-1.65	-1.59	-1.55	0.02%
합성선물 베이시스(ATM)	0.28	-1.29	-1.29	-0.49%



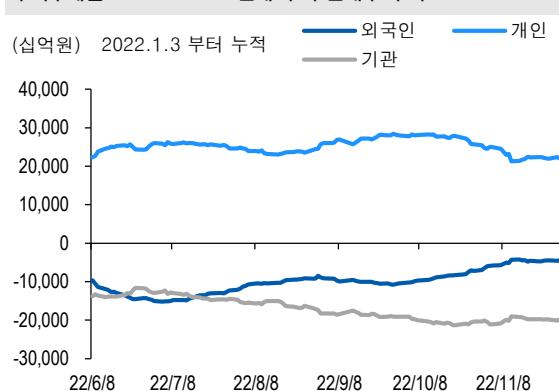
## 투자주체별 매매 동향

(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+국가지자체	-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



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

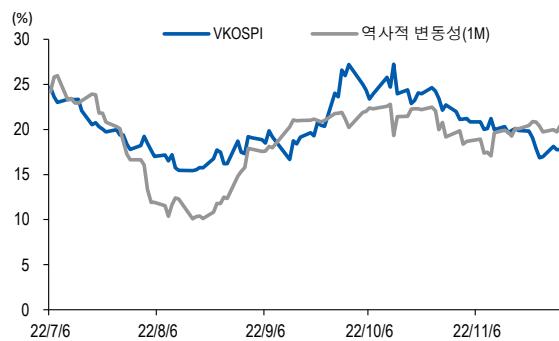
(계약, 십억원)								
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,252,356	345.0	1,033,771	11.9%	지수옵션 전체	2,441,027	580.6	2,716,717
Put	1,188,671	235.6	1,682,946	20.1%	PCR(금액기준)	0.68	VKOSPI	17.78% (+0.02%p)

	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

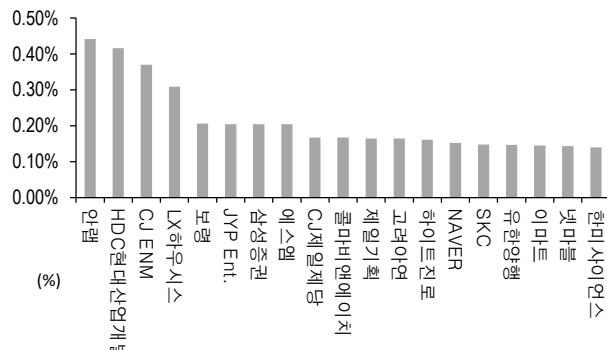
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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
삼성전자	61,700	1.82	529.9	52.4	1,068,418	-37,686	-0.06%	-8,825	-23,681	32,075
삼성전기	139,000	3.35	60.1	49.4	14,685	-747	-0.04%	-2,703	429	2,244
일진마티리얼즈	61,800	0.49	6.8	48.1	49,705	215	0.05%	1,117	-148	-969
현대차	169,500	-0.29	34.2	47.2	43,235	-1,055	0.12%	-442	288	159
호텔신라	72,900	1.11	7.8	41.0	10,233	-95	-0.08%	-869	-912	1,784
SK 하이닉스	85,100	1.19	111.1	39.9	187,996	-598	0.11%	-1,976	2,497	-618
LG 전자	97,700	3.83	65.7	39.0	34,957	5,337	0.13%	5,809	3,220	-8,986
SK 이노베이션	177,000	0.85	31.7	37.2	17,358	-2,817	-0.03%	9	-2,999	2,976
포스코케미칼	218,000	-2.02	67.0	37.2	33,520	484	-0.03%	-191	-383	723
롯데케미칼	183,000	-0.54	8.5	37.1	22,817	-903	-0.02%	-634	320	319

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터