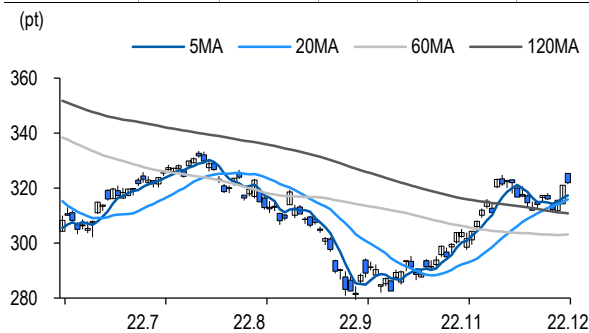


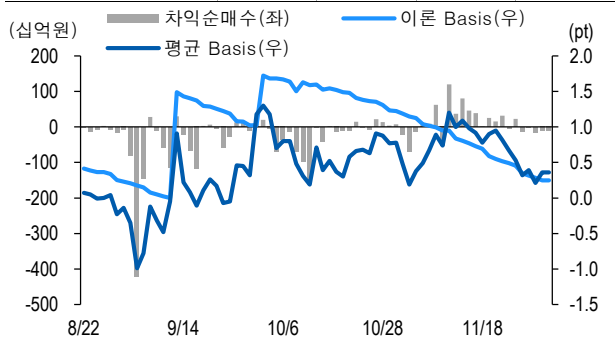
선물옵션시장 지표

2022.12.2

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	322.02	0.32	1.02	6,200.0	-
선물 12월물	323.10	1.08	3.45	26,600.1	304,342
선물 3월물	321.70	1.20	3.80	675.3	36,648
12월물(mini)	323.10	1.08	3.40	1,275.3	50,182
1월물(mini)	320.20	1.17	3.70	33.6	25,516



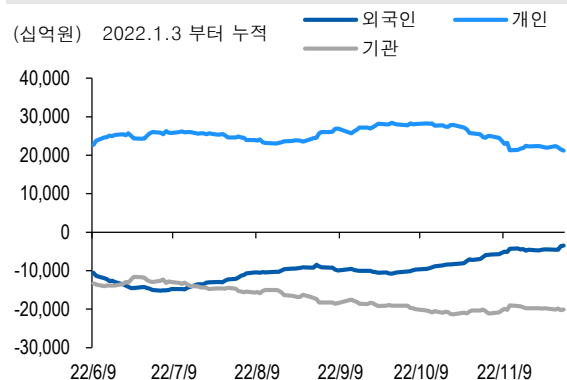
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.25	0.36	1.08	0.03%
베이스스(mini)	0.25	0.36	1.08	0.03%
제1스프레드(SP)	-1.64	-1.41	-1.40	0.07%
합성선물 베이스스(ATM)	0.25	1.11	1.11	0.27%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	32.5	58.0	90.5	-6.4	8.7	-861.7	-26.6	-4.7	2.5	-31.6
개인	-279.1	-60.8	-339.9	0.0	0.3	345.0	13.8	6.7	-5.2	12.2
기관	227.5	2.1	229.6	-4.9	-44.0	405.2	9.8	-2.9	4.4	20.5
금융투자	252.1	12.5	264.6	-5.0	-5.0	213.2	8.7	-2.6	4.1	-8.3
투신	4.1	5.7	9.7	0.0	-1.2	126.6	1.1	0.0	0.0	31.7
은행+보험+기타금융	-6.2	-23.2	-29.4	0.0	-1.6	65.9	0.0	-0.3	0.4	-0.6
연기금+국가지자체	-18.8	0.7	-18.0	0.1	-22.5	-0.5	0.0	0.0	0.0	-2.3
기타법인	19.1	0.7	19.8	0.0	0.4	111.5	3.1	0.9	-1.8	-1.1

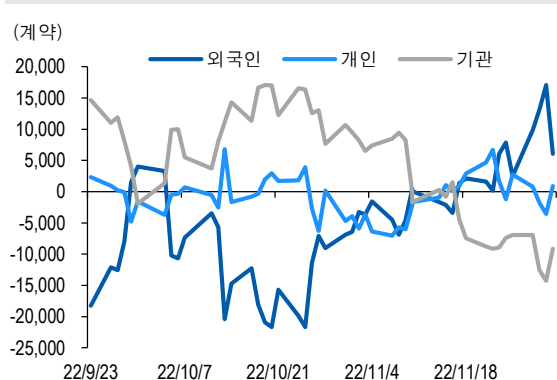
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,458,006	375.1	1,094,229	15.7%	지수옵션 전체	2,715,199	641.4	2,827,562
Put	1,257,193	266.4	1,733,333	14.4%	PCR(금액기준)	0.71	VKOSPI	17.51%(-0.27%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	1.08	0.46	216,371	24,242	-719	15.6	Put	322.5(K+1)	2.49	-2.26	100,608	18,228	9,262	12.6
	325.0(K+2)	1.92	0.77	163,074	27,548	-4,643	16.1		320.0(K+0)	1.56	-1.74	140,344	27,653	11,281	13.4
	322.5(K+1)	3.13	1.14	61,992	23,662	-43	17.0		317.5(K-1)	0.94	-1.35	154,502	18,590	6,786	14.2
	320.0(K+0)	4.69	1.61	24,266	27,936	-383	18.0		315.0(K-2)	0.55	-0.93	181,673	29,166	5,079	15.0
	317.5(K-1)	6.56	2.09	5,271	14,779	-1,089	19.4		312.5(K-3)	0.33	-0.66	100,620	24,713	2,517	15.9

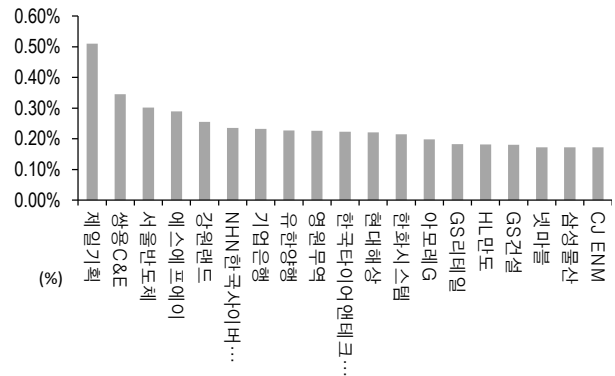
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,104,182	1,958.9	5,226,227	17,109	2,566	2,421	-2,423	-31.6	12.2	20.5	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	63,600	2.91	9.9	59.9	51,457	1,752	0.13%	1,619	496	-2,121	-1,688	-435
삼성전기	136,500	-1.80	56.9	56.1	16,563	1,878	-0.01%	-3,076	1,233	1,828	1,368	110
SK 하이닉스	85,100	0.00	130.8	52.9	191,925	3,929	0.16%	-10,398	5,714	4,682	-12,147	48
삼성전자	62,700	1.62	510.5	49.2	1,042,784	-25,634	0.00%	-13,289	-3,922	15,096	19,676	-3,800
한국조선해양	77,200	-1.91	5.3	48.2	4,116	-670	-0.01%	-1,591	139	1,453	1,502	-49
LG 전자	96,300	-1.43	27.6	44.6	33,462	-1,495	0.00%	-2,281	547	1,708	873	749
삼성 SDI	728,000	0.14	48.6	43.5	19,236	169	0.11%	-310	399	-87	-68	-21
현대차	172,000	1.47	36.3	42.5	42,454	-781	0.09%	-769	-102	823	673	150
엔씨소프트	465,000	-0.43	12.8	42.3	4,347	-110	0.01%	-521	154	367	80	286
한국금융지주	58,900	2.97	4.0	41.2	26,285	-1,379	-0.07%	-586	564	43	529	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터