

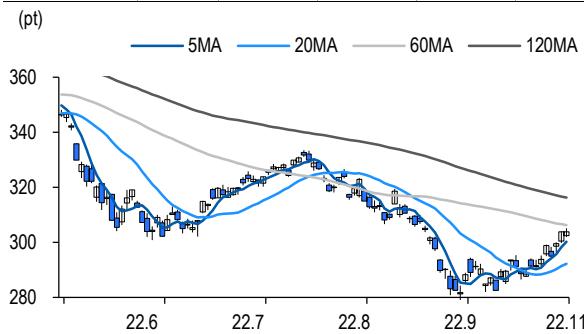


선물옵션시장 지표

2022.11.3

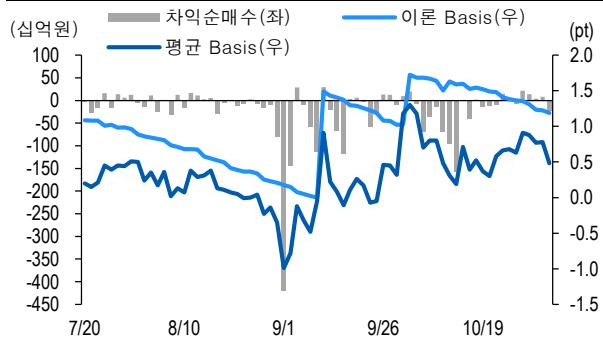
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	303.87	0.00	-0.01	7,240.0	-
선물 12월물	304.45	0.18	0.55	18,677.7	336,490
선물 3월물	302.15	0.07	0.20	25.4	19,047
11월물(mini)	304.04	0.14	0.44	1,176.6	68,514
12월물(mini)	304.48	0.19	0.18	5.9	7,395



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.19	0.48	0.58	-0.23%
베이시스(mini)	0.26	0.09	0.17	-0.06%
제1스프레드(SP)	-1.87	-2.26	-2.30	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.26	0.23	0.23	-0.01%



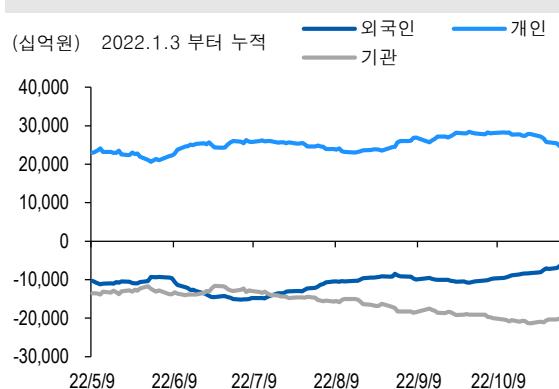
투자주체별 매매 동향

(십억원)

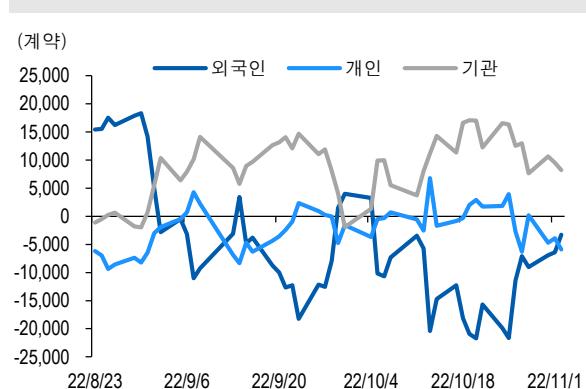
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	495.5	8.1	503.6	-0.9	379.0	97.9	142.0	-2.5	-5.2	-39.9
개인	-183.4	25.5	-157.9	0.0	-2.3	-106.3	-45.4	5.6	1.3	28.5
기관	-338.3	-34.0	-372.4	-21.3	-21.5	-6.6	-90.7	-3.6	4.3	13.0
금융투자	-354.1	-21.7	-375.8	-12.0	-8.0	271.3	-90.7	-3.9	4.3	-2.1
투신	24.3	-9.8	14.5	0.0	12.3	-294.7	0.0	0.3	0.0	16.4
은행+보험+기타금융	8.5	-11.7	-3.2	0.0	-1.7	12.5	0.0	0.0	-0.1	-0.2
연기금+국가지자체	-23.5	-3.3	-26.8	-1.5	-13.5	4.2	0.0	0.0	0.0	-1.1
기타법인	26.3	0.3	26.6	0.0	-0.4	14.9	-5.9	0.5	-0.4	-1.6

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	913,324	266.8	1,146,652	19.2%	지수옵션 전체	1,792,326	481.9	3,011,063							
Put	879,002	215.1	1,864,411	21.2%	PCR(금액기준)	0.81	VKOSPI	21.13%(+0.02%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	312.5(K+3)	0.93	0.10	131,000	35,254	-1,665	19.1	Put	307.5(K+1)	5.75	-0.11	1,314	1,282	320	20.2
	310.0(K+2)	1.51	0.12	123,248	38,879	1,060	19.4		305.0(K+0)	4.32	-0.29	22,623	7,001	3,419	20.4
	307.5(K+1)	2.33	0.16	107,452	26,735	1,324	19.7		302.5(K-1)	3.17	-0.25	43,897	10,862	5,680	20.8
	305.0(K+0)	3.42	0.30	59,052	31,805	330	20.0		300.0(K-2)	2.23	-0.24	60,842	18,561	962	21.0
	302.5(K-1)	4.74	0.30	19,983	28,484	252	20.3		297.5(K-3)	1.55	-0.17	86,141	17,978	3,692	21.4

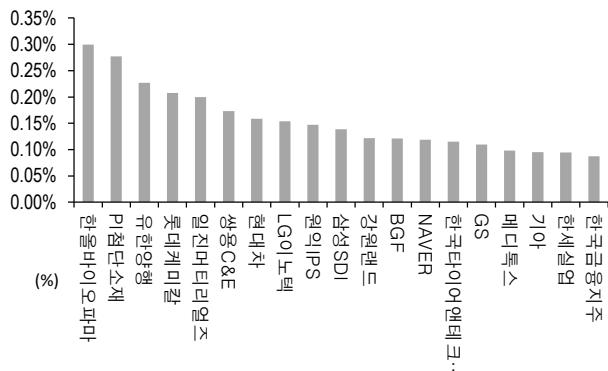
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역시적 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	4,068,998	2,805.2	4,874,267	16,631	-136,537	72,878	65,961	-39.9	28.5	13.0		
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수
SK 하이닉스	84,800	1.07	169.1	79.5	170,793	-8,753	-0.02%	-7,197	6,772	409	-2,402	74
일진마티리얼즈	62,800	0.96	27.7	75.3	55,244	6,175	0.20%	-2,215	6,725	-4,710	-5,590	880
삼성전자	59,800	-0.33	569.4	72.7	1,220,140	-19,822	-0.01%	21	-2,485	3,189	-11,751	-875
현대차	164,500	0.00	100.9	66.5	46,697	2,612	0.16%	764	278	-1,373	-128	-457
코스맥스	49,150	2.61	1.5	65.7	2,150	-391	-0.24%	75	-342	267	267	0
NAVER	174,000	1.75	167.5	62.0	40,105	-1,107	0.12%	174	-1,308	1,039	-1,192	335
한화솔루션	48,950	-0.61	43.8	58.5	67,150	-3,260	0.01%	-5,973	2,635	3,339	2,168	1,515
KB 금융	47,750	0.63	25.7	57.0	28,183	-1,252	-0.14%	-505	-1,455	2,541	1,564	932
LG 화학	674,000	-3.44	157.3	57.0	11,111	-314	-0.01%	-369	1,144	-831	-1,106	-138
엔씨소프트	399,500	3.23	31.3	55.1	4,259	-525	-0.12%	356	-670	329	186	143

자료: KBX 유티즌워리리서치센터