

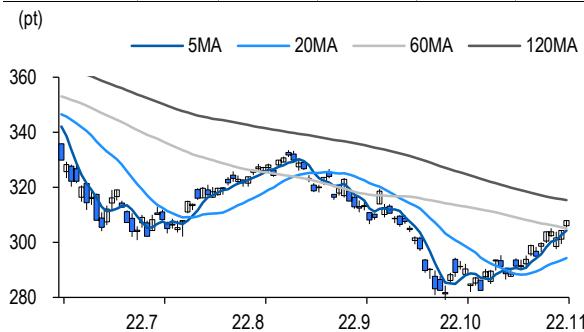


선물옵션시장 지표

2022.11.8

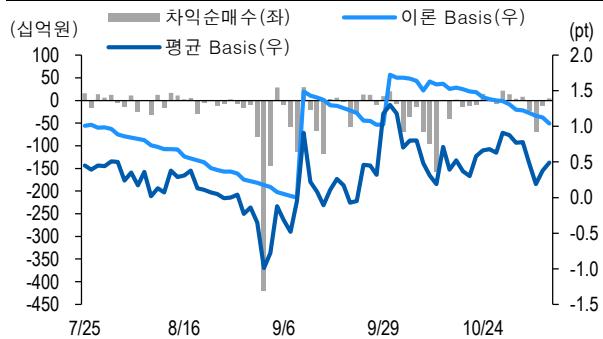
Market Data (십억원, 계약)

	종가(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	괴리율(%)
K200 베이시스	1.04	0.49	1.13	-0.18%
베이시스(mini)	0.10	0.18	0.67	0.03%
제1스프레드(SP)	-1.83	-2.22	-2.25	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	0.58	0.58	0.16%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

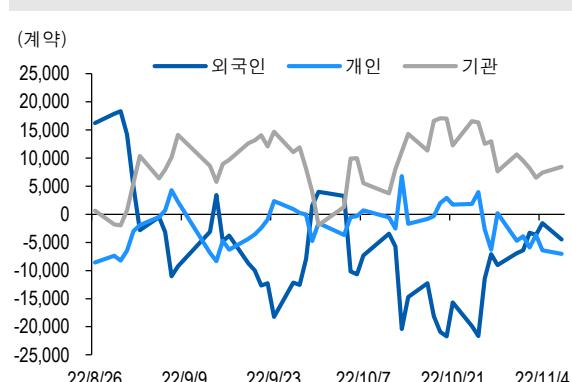
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	112.2	20.2	132.4	8.0	87.1	-143.8	-83.3	-4.3	-4.0	25.9
개인	-405.8	-31.3	-437.1	0.0	0.8	-96.6	45.2	4.6	-0.5	-23.3
기관	276.7	16.9	293.6	-3.5	-38.9	45.9	37.8	0.2	5.1	-2.3
금융투자	254.0	49.1	303.1	-1.9	5.2	-77.9	38.2	-0.9	4.5	-40.7
투신	50.8	-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+국가지자체	-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



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	312.5(K+3)	0.92	0.24	349,632	40,596	1,478	19.8	307.5(K+1)	2.14	-2.35	107,533
	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
	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
	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
	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
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	307.5(K+1)	2.14	-2.35	107,533	10,799	8,952	18.6	305.0(K+0)	1.25	-1.89	199,377
	302.5(K-1)	0.71	-1.41	239,461	22,105	5,527	20.2	300.0(K-2)	0.38	-0.97	298,069
	300.0(K-2)	0.38	-0.97	298,069	31,769	11,121	21.1	297.5(K-3)	0.21	-0.58	278,060
	297.5(K-3)	0.21	-0.58	278,060	25,594	4,738	22.2				

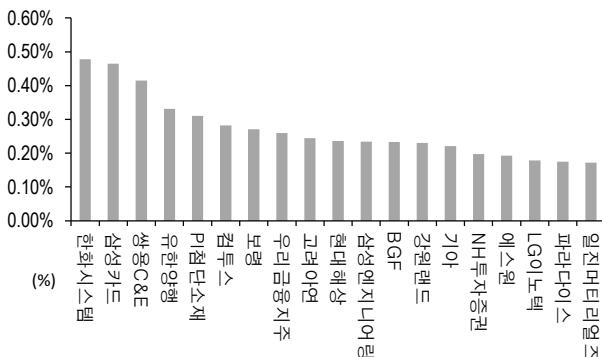
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,974,418	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(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
코스맥스	50,700	1.40	2.3	82.6	1,954	-319	0.14%	-109	-26	132
LG 디스플레이	13,400	-1.47	16.4	80.0	174,501	-43,195	0.03%	-6,041	-9,344	15,385
SK 이노베이션	180,500	1.98	71.0	71.7	15,389	-9,416	0.11%	2,638	956	-3,596
일진미티리얼즈	62,800	0.32	8.6	67.9	50,224	-2,123	0.17%	1,083	-1,026	132
LG 화학	702,000	1.74	106.5	67.2	10,212	-877	0.03%	158	-10	-186
삼성 SDI	741,000	0.68	115.7	66.3	18,002	-1,674	0.05%	251	-92	-163
SK 하이닉스	86,500	2.49	156.1	66.1	157,129	-10,713	-0.02%	4,984	-14,050	9,066
삼성전자	60,000	0.84	482.9	64.8	941,589	-204,390	-0.05%	18,794	-7,577	-11,367
삼성전기	125,500	1.21	40.9	63.0	36,275	-1,348	0.06%	846	-1,653	777
현대차	170,000	3.66	110.2	58.3	44,710	953	0.11%	2,057	1,028	-3,015

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터