

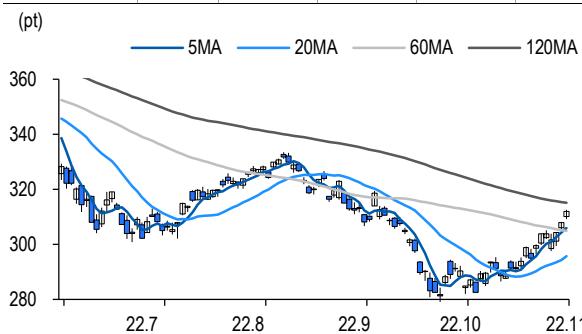


선물옵션시장 지표

2022.11.9

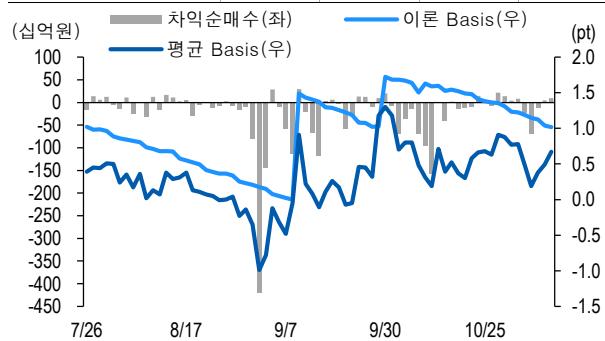
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.01	1.34	4.14	6,630.1	-
선물 12월물	312.95	1.28	3.95	24,886.4	334,121
선물 3월물	310.85	1.37	4.20	114.6	18,613
11월물(mini)	312.44	1.26	3.90	1,467.8	93,990
12월물(mini)	312.86	1.25	4.08	41.3	9,465



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.02	0.67	0.94	-0.11%
베이시스(mini)	0.07	0.26	0.43	0.06%
제1스프레드(SP)	-1.79	-2.20	-2.25	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.07	0.40	0.40	0.11%



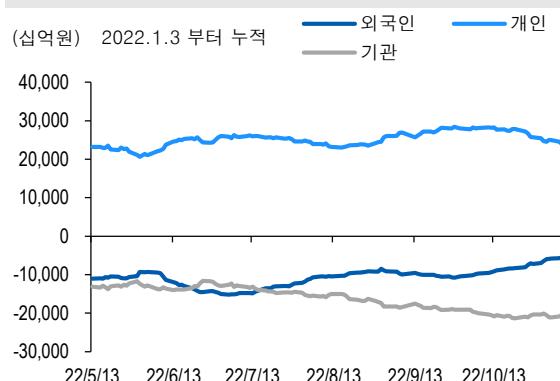
투자주체별 매매 동향

(십억원)

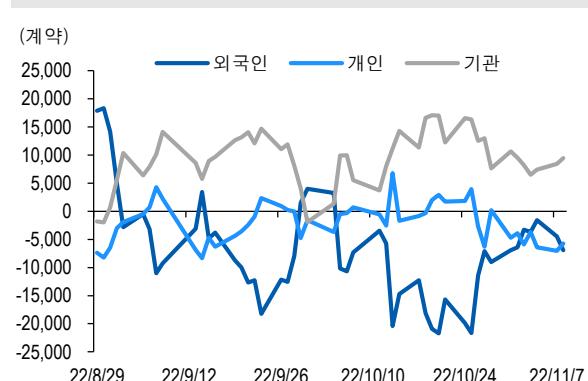
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	273.9	3.1	277.0	8.1	158.5	-162.4	-26.4	-10.8	0.2	40.2
개인	-723.8	-27.0	-750.7	0.0	-1.4	95.3	8.6	10.2	-6.1	-21.8
기관	440.3	20.1	460.4	1.3	29.2	62.6	14.5	1.5	6.5	-19.1
금융투자	490.1	61.2	551.4	1.4	41.8	-98.2	11.0	-1.7	3.5	-63.6
투신	-0.2	-9.6	-9.8	0.0	7.9	76.9	-1.6	0.7	0.0	46.9
은행+보험+기타금융	6.0	-13.9	-7.9	0.0	-2.7	30.0	5.0	2.5	3.1	0.2
연기금+국가지자체	-10.2	-12.0	-22.2	0.0	-0.4	53.9	0.0	0.0	0.0	-2.6
기타법인	9.6	3.7	13.3	0.0	0.0	4.6	3.3	-0.9	-0.5	0.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,068,808	503.6	1,237,745	18.1%	지수옵션 전체	4,008,236	852.9	3,435,186
Put	1,939,428	349.3	2,197,441	19.5%	PCR(금액기준)	0.69	VKOSPI	19.99%(-0.83%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	315.0(K+3)	0.87	0.46	468,537	33,244	-2,938	17.5	Put	310.0(K+1)	1.05	-2.32	258,488	19,510	14,659	17.1
	312.5(K+2)	1.89	0.97	398,057	34,127	-6,469	18.4		307.5(K+0)	0.49	-1.65	357,404	23,627	12,828	17.9
	310.0(K+1)	3.46	1.65	187,804	34,017	-6,425	20.0		305.0(K-1)	0.25	-1.00	359,251	26,703	7,926	19.6
	307.5(K+0)	5.40	2.35	35,135	24,487	-2,568	21.7		302.5(K-2)	0.14	-0.57	263,106	32,319	10,214	21.6
	305.0(K-1)	7.72	3.02	9,806	27,339	-2,382	25.7		300.0(K-3)	0.07	-0.31	167,540	40,525	8,756	23.0

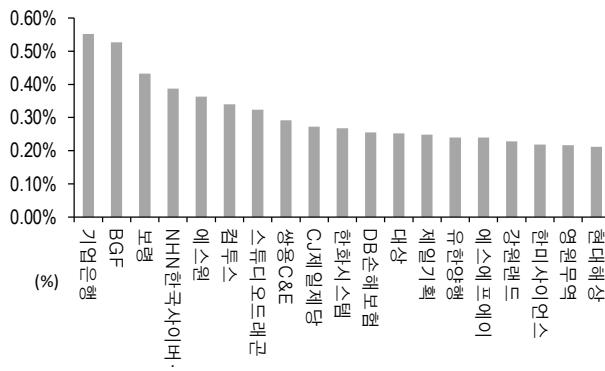
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	4,553,301	3,108.2	4,990,155	107,423	81,136	-112,592	30,713	40.2	-21.8	-19.1

종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수
SK 하이닉스	88,000	1.73	191.5	77.7	135,781	-21,348	0.04%	1,000	-7,874	6,971	-1,001	-357
한국항공우주	48,450	2.98	26.4	70.3	21,415	-8,525	0.05%	-1,722	-1,709	3,412	-4,840	-932
한국금융지주	53,300	0.95	7.7	68.5	14,324	-8,072	0.17%	626	69	-695	-3,906	-194
삼성 SDI	731,000	-1.35	158.5	62.9	13,347	-4,655	0.05%	700	272	-961	-300	-104
LG 디스플레이	14,450	7.84	43.1	61.4	121,990	-52,511	-0.17%	27,734	-92,187	64,453	42,965	2,112
일진마티리얼즈	63,300	0.80	10.4	61.3	49,159	-1,065	0.19%	1,360	-760	-601	-618	17
LG 화학	693,000	-1.28	111.2	60.5	9,402	-810	0.06%	37	196	-234	-154	-120
현대차	170,000	0.00	78.8	57.8	42,978	-1,732	0.15%	1,511	-669	-870	-799	81
삼성전기	129,500	3.19	46.9	55.9	35,989	-286	0.17%	3,743	-2,609	-1,134	-5,646	-239
엔씨소프트	410,500	1.86	20.5	55.9	3,156	-1,019	-0.14%	574	-1,065	493	427	65

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터