

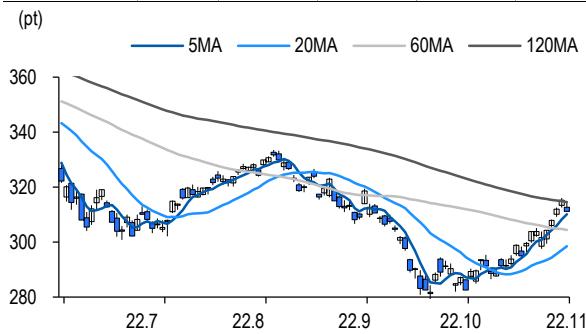


선물옵션시장 지표

2022.11.11

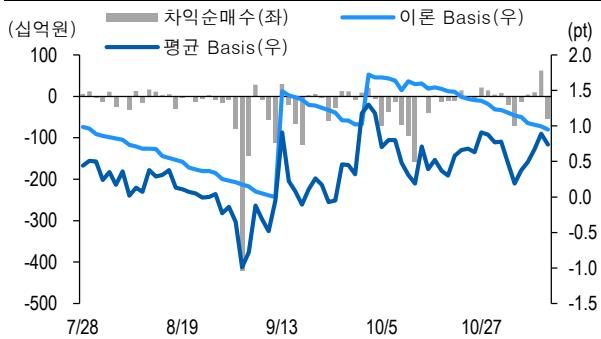
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	311.13	-1.30	-4.10	6,818.3	-
선물 12월물	311.45	-1.52	-4.80	28,878.4	325,317
선물 3월물	309.25	-1.51	-4.75	97.3	19,206
11월물(mini)	311.88	-1.21	-3.82	959.0	0
12월물(mini)	311.20	-1.60	-4.94	974.9	31,593



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.95	0.74	0.32	-0.07%
베이시스(mini)	0.00	0.09	0.75	0.03%
제1스프레드(SP)	-1.80	-2.23	-2.20	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	0.72	0.72	0.23%



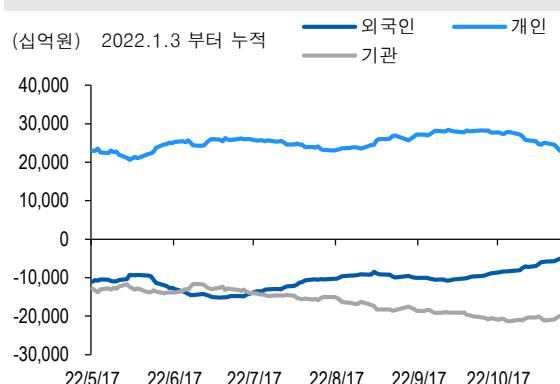
투자주체별 매매 동향

(십억원)

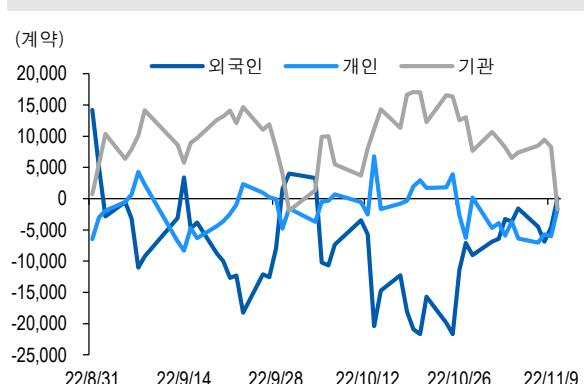
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-117.5	-4.3	-121.8	-54.8	0.8	436.0	-70.1	-13.6	0.6	43.3
개인	238.3	21.6	259.9	0.0	6.6	317.5	22.4	9.2	2.6	29.5
기관	-158.1	-20.1	-178.2	1.2	-227.8	-834.6	56.4	5.5	-2.6	-71.4
금융투자	2.5	35.1	37.6	-1.4	-193.4	-423.5	50.1	1.8	-0.5	3.6
투신	-28.0	-14.0	-42.0	-0.7	-2.6	-374.9	-3.1	1.1	-0.1	0.7
은행+보험+기타금융	-10.0	-12.6	-22.6	0.0	-12.0	-34.3	9.3	2.7	-2.1	0.4
연기금+국가지자체	-55.4	-26.9	-82.3	3.3	-12.8	-2.0	0.0	-0.1	0.0	-76.0
기타법인	37.3	2.7	40.1	0.0	0.6	81.1	-8.6	-1.2	-0.6	-1.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,709,101	411.9	663,229	12.8%	지수옵션 전체	5,124,710	834.0	1,740,657
Put	2,415,609	422.1	1,077,428	9.6%	PCR(금액기준)	1.02	VKOSPI	21.21%(+1.11%p)

	행사가	종가	등락	거래량	미결제액정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락	거래량	미결제액정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	0.01	-0.02	13,417	0	-34,395	27.6	Put	317.5(K+1)	5.71	3.28	25,572	0	-5,797	27.3
	320.0(K+2)	0.01	-0.12	146,016	0	-52,219	22.3		315.0(K+0)	3.16	2.07	374,639	0	-19,488	16.7
	317.5(K+1)	0.01	-0.60	550,611	0	-34,938	16.7		312.5(K-1)	0.80	0.41	1,036,579	0	-26,656	8.2
	315.0(K+0)	0.01	-1.73	1,084,927	0	-28,872	10.9		310.0(K-2)	0.05	-0.08	568,224	0	-31,163	5.8
	312.5(K-1)	0.15	-3.39	648,418	0	-29,300	9.1		307.5(K-3)	0.01	-0.04	84,905	0	-49,852	10.6

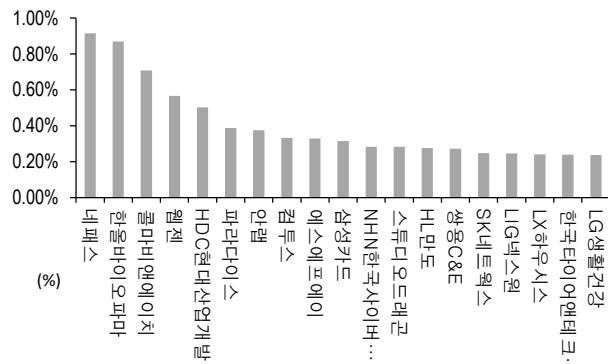
자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KBX 유아티즈권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KBX 유아티증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	5,635,029	3,828.0	3,718,670	-1,276,493	59,547	41,050	-99,705	43.3	29.5	-71.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
대한항공	24,650	0.00	18.1	51.6	0	-65,253	0.16%	-4,234	1,890	2,344	9,328	-11,224
삼성 SDI	724,000	-2.29	99.9	43.9	0	-11,300	0.04%	86	986	-1,095	653	-1,396
삼성전자	60,600	-2.10	555.5	43.4	0	-509,461	0.00%	78,565	16,426	-94,591	-42,362	-43,467
LG 전자	91,400	-1.93	26.3	35.5	0	-25,604	-0.07%	1,528	-3,633	1,983	2,152	-219
고려아연	614,000	-0.97	15.8	34.6	0	-3,195	-0.13%	141	-375	451	300	151
한화솔루션	49,550	0.41	49.2	33.9	0	-44,517	-0.07%	-3,311	1,886	1,385	174	1,231
LG 디스플레이	14,250	0.00	9.4	32.2	0	-84,050	0.10%	-4,974	-1,642	6,614	1,614	-2,266
삼성전기	137,000	-1.44	31.6	31.0	0	-30,303	-0.08%	-4,705	-909	5,646	4,714	587
SK 이노베이션	181,500	-0.82	15.6	30.8	0	-12,761	0.02%	1,136	111	-1,247	676	54
JYP Ent.	56,300	1.26	5.5	30.8	0	-6,965	0.23%	207	135	-349	-668	0

자료: KBX 유아티즈권 리서치센터