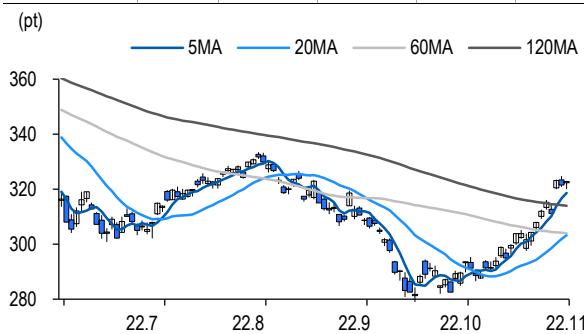


## 선물옵션시장 지표

2022.11.16

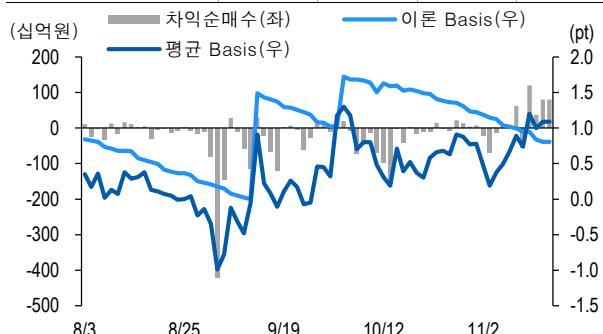
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	322.31	0.24	0.78	6,458.9	-
선물 12월물	323.00	0.12	0.40	22,531.1	307,588
선물 3월물	320.80	0.17	0.55	247.2	18,941
12월물(mini)	322.98	0.12	0.38	1,412.4	46,543
1월물(mini)	319.26	0.24	0.76	2.6	15,115



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.81	1.09	0.69	0.09%
베이시스(mini)	0.81	1.09	0.67	0.09%
제1스프레드(SP)	-1.68	-2.24	-2.25	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.81	0.74	0.74	-0.02%



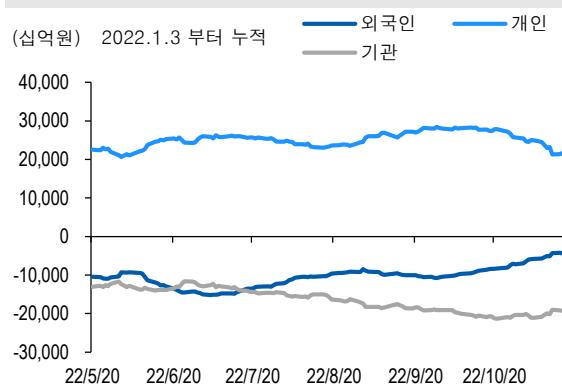
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-265.1	-9.3	-274.4	62.9	-109.6	-105.6	71.1	-1.8	-1.5	-13.2
개인	326.5	7.5	334.0	0.0	-1.4	160.8	1.0	0.6	0.2	14.9
기관	-80.1	-5.3	-85.4	17.5	6.9	-13.5	-72.0	1.7	2.3	-3.6
금융투자	225.9	-3.1	222.8	12.7	92.5	-69.7	-64.8	1.8	1.5	12.9
투신	-105.6	1.6	-104.0	-0.1	-35.0	53.0	-7.2	-0.1	0.0	-12.4
은행+보험+기타금융	-17.6	-10.3	-27.9	0.0	3.1	-0.8	0.0	0.0	0.8	0.6
연기금+국가지자체	-76.8	0.0	-76.9	4.8	-29.7	3.9	0.0	0.0	0.0	-4.6
기타법인	18.7	7.2	25.8	0.0	-0.3	-41.7	-0.1	-0.5	-1.0	1.8

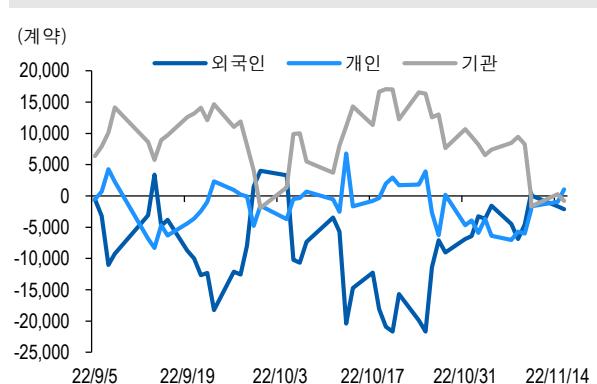
자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	643,997	231.5	814,544	17.2%	지수옵션 전체	1,320,711	469.8	2,128,522							
Put	676,714	238.3	1,313,978	18.9%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	19.63%(-0.69%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	330.0(K+3)	2.93	-0.13	48,752	25,071	-165	17.1	Put	325.0(K+1)	6.89	-0.55	4,078	5,382	162	17.9
	327.5(K+2)	3.85	-0.16	25,839	12,436	1,254	17.4		322.5(K+0)	5.65	-0.55	14,874	7,823	1,389	18.1
	325.0(K+1)	4.94	-0.07	17,003	16,409	-499	17.6		320.0(K-1)	4.59	-0.50	16,785	14,053	1,095	18.4
	322.5(K+0)	6.20	-0.10	12,740	8,020	1,013	17.8		317.5(K-2)	3.72	-0.46	18,686	5,945	616	18.8
	320.0(K-1)	7.64	-0.02	8,307	17,568	100	18.1		315.0(K-3)	2.96	-0.43	33,896	13,788	2,036	19.0

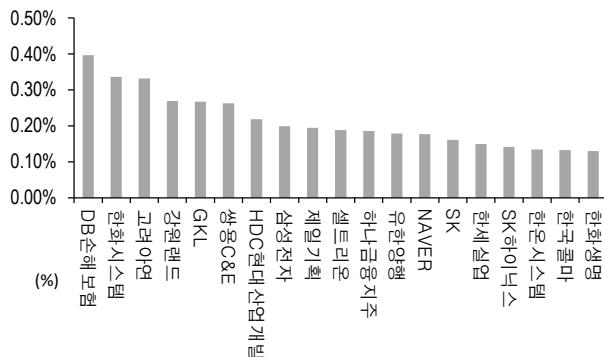
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	3,306,349	2,339.1	4,557,319	172,106	-37,555	27,057	9,735	-13.2	14.9	-3.6	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
삼성전자	62,700	0.64	653.2	86.0	1,165,015	36,604	0.20%	-1,252	982	339	-1,632
현대차	174,500	-1.13	101.3	69.4	43,888	108	0.04%	-3,235	709	2,517	3,477
LG 이노텍	325,500	2.84	55.1	69.3	13,298	2,198	0.05%	372	-1,738	1,371	272
SK 하이닉스	92,100	0.77	152.0	67.9	157,160	10,552	0.14%	12,716	5,289	-18,005	-18,295
삼성전기	143,500	2.14	42.1	67.5	16,103	1,015	-0.26%	200	-2,469	2,269	2,179
LG 디스플레이	14,900	1.02	9.3	60.8	198,640	4,681	0.03%	5,684	13,019	-18,943	-8,573
현대제철	33,700	1.05	8.1	55.7	12,909	-1,783	-0.19%	-2,995	-539	3,438	3,293
한국항공우주	46,000	-0.54	17.5	53.3	18,357	3,230	0.01%	1,322	-397	-967	-540
한화솔루션	49,500	-0.80	37.8	50.8	66,343	2,260	-0.03%	-2,207	622	1,573	1,725
KB 금융	49,600	-0.20	19.3	50.1	47,989	2,636	0.02%	643	-718	70	70

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터