

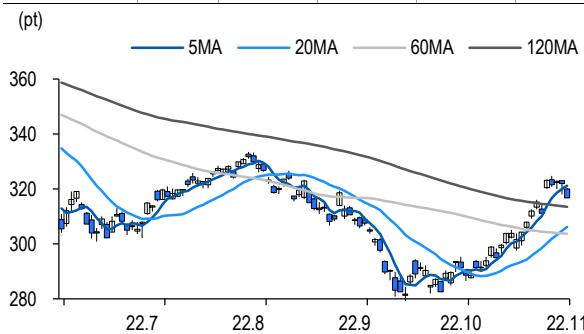


선물옵션시장 지표

2022.11.18

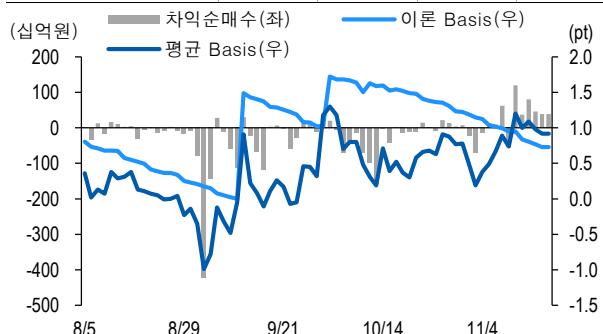
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.75	-1.62	-5.21	5,951.9	-
선물 12월물	319.25	-1.15	-3.70	22,707.3	300,176
선물 3월물	317.00	-1.11	-3.55	127.8	19,782
12월물(mini)	319.12	-1.19	-3.68	1,288.6	45,777
1월물(mini)	315.20	-1.13	-3.60	3.1	15,178



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.73	0.92	2.50	0.06%
베이시스(mini)	0.73	0.92	2.37	0.06%
제1스프레드(SP)	-1.74	-2.19	-2.20	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.73	2.45	2.45	0.54%



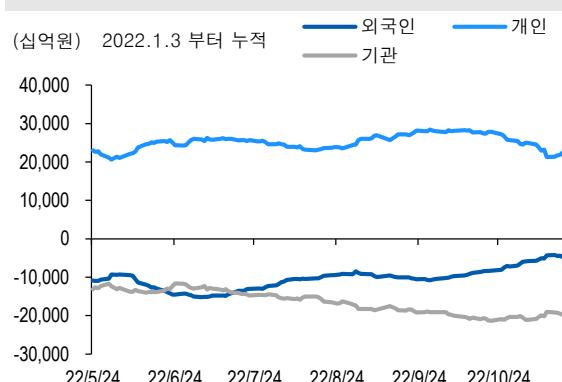
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-382.1	5.6	-376.4	12.3	-228.7	413.4	-33.0	-0.5	-1.5	7.8
개인	487.9	41.7	529.6	0.0	-0.3	32.6	24.4	-0.5	-0.2	-20.3
기관	-120.4	-55.0	-175.4	27.1	56.8	-480.0	5.9	1.3	1.8	10.6
금융투자	22.7	-48.7	-26.0	17.6	78.8	-51.4	-2.8	1.8	1.4	40.9
투신	-13.2	-15.9	-29.2	6.2	1.1	-340.5	8.5	-0.5	0.0	-30.5
은행+보험+기타금융	-24.0	21.2	-2.8	0.0	-1.8	-83.0	0.2	0.0	0.4	0.1
연기금+국가지자체	-49.9	-2.5	-52.4	0.1	-18.6	-5.1	0.0	0.0	0.0	0.2
기타법인	14.5	7.7	22.2	0.0	0.5	34.0	2.7	-0.3	-0.1	1.9

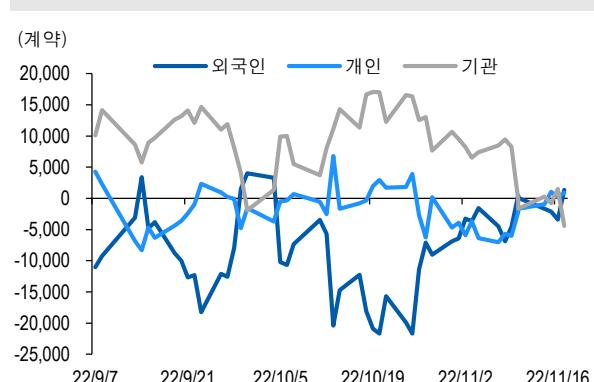
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향									(계약, 십억원)						
	거래량	거래대금	미결제약정		대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정					
Call	622,604	206.4	878,642		19.1%		지수옵션 전체	1,360,722	485.2	2,295,418					
Put	738,118	278.8	1,416,776		16.0%		PCR(금액기준)	1.35	VKOSPI	20.09%(+0.22%p)					
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	1.68	-1.06	67,941	29,466	1,255	18.8	Put	325.0(K+1)	9.06	2.21	795	5,636	26	13.8
	327.5(K+2)	2.31	-1.34	38,893	15,227	1,456	19.1		322.5(K+0)	7.36	1.75	5,749	9,123	576	14.2
	325.0(K+1)	3.09	-1.63	39,304	18,260	2,052	19.5		320.0(K-1)	5.94	1.38	14,815	16,404	-570	14.7
	322.5(K+0)	4.06	-1.91	21,215	10,137	1,409	19.9		317.5(K-2)	4.85	1.18	19,059	7,606	1,258	15.6
	320.0(K-1)	5.22	-2.20	14,617	18,504	-75	20.5		315.0(K-3)	3.90	0.95	28,917	14,761	-81	16.4

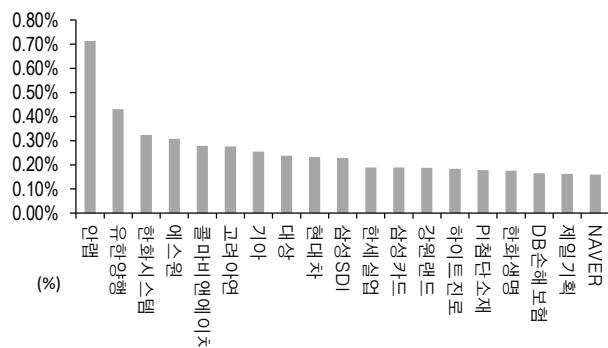
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주실선물 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	2,832,190	1,909.9	4,638,442	77,624	-50,231	-33,186	82,028	7.8	-20.3	10.6		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전기	138,500	0.00	46.9	84.7	19,063	1,690	-0.18%	1,326	-2,580	1,260	1,564	-164
현대차	170,500	-1.73	65.9	78.1	45,016	1,453	0.23%	2,017	-304	-1,654	-1,491	-163
삼성전자	61,700	-1.75	606.0	74.0	1,171,317	13,355	0.04%	4,698	-18,590	14,357	16,507	400
현대제철	33,500	-0.74	6.6	62.5	13,008	199	-0.05%	-621	-491	1,112	1,197	-85
SK 하이닉스	88,200	-4.23	182.3	56.4	170,839	10,601	0.08%	5,351	-8,013	2,366	2,002	1,006
LG 전자	92,800	-3.43	25.1	51.1	27,743	-3,794	-0.15%	1,181	720	-1,999	3,588	1,637
일진마티리얼즈	64,700	-2.12	6.9	50.4	57,366	106	0.02%	528	125	-653	-532	-121
롯데케미칼	169,500	-5.31	31.2	49.5	30,523	-1,838	-0.41%	-582	400	-368	368	-22
포스코케미칼	226,000	-0.22	65.1	48.6	33,135	-1,298	-0.06%	1,674	215	-1,891	-1,706	-298
LG 이노텍	308,500	-3.14	25.2	48.5	12,455	-45	-0.19%	538	-799	261	473	-72

자료: KBX 유티즌워리서치센터