

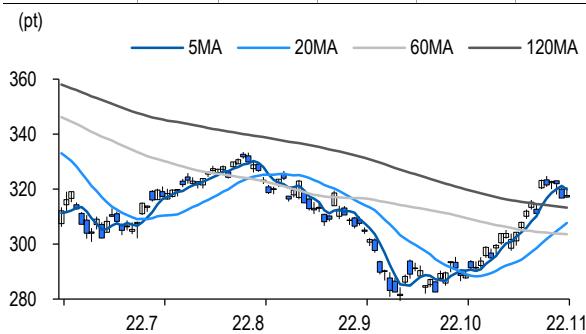


선물옵션시장 지표

2022.11.21

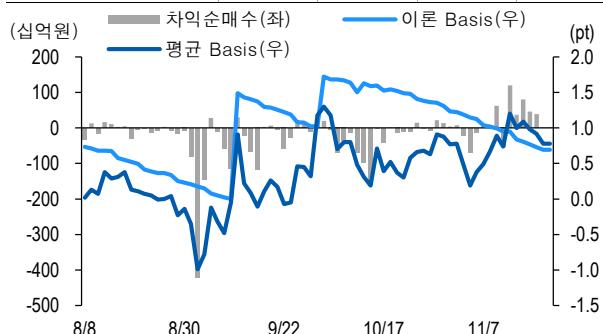
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	317.12	0.12	0.37	5,311.7	-
선물 12월물	317.45	-0.56	-1.80	23,980.8	299,827
선물 3월물	315.35	-0.52	-1.65	129.0	19,930
12월물(mini)	317.48	-0.56	-1.64	1,369.4	45,465
1월물(mini)	313.82	-0.44	-1.38	2.1	15,191



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.69	0.78	0.33	0.03%
베이시스(mini)	0.69	0.78	0.36	0.03%
제1스프레드(SP)	-1.73	-2.13	-2.15	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.69	0.32	0.32	-0.12%



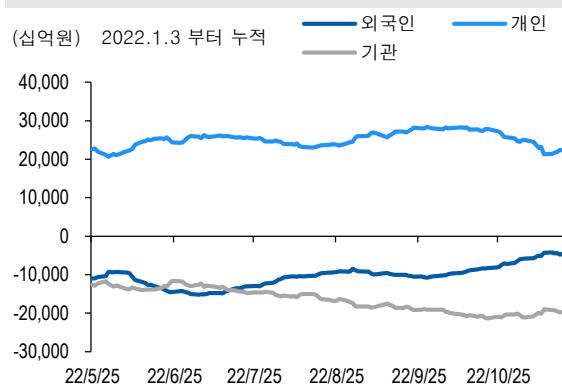
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	199.7	-8.6	191.1	3.2	340.2	55.3	7.4	-1.3	2.8	0.8
개인	-150.4	23.5	-126.9	0.0	-2.0	172.4	-12.9	-1.4	-0.1	41.0
기관	-77.5	15.0	-62.5	-1.4	7.6	-242.0	3.9	2.7	-3.0	-42.7
금융투자	-6.6	104.9	98.2	0.1	58.2	-76.0	-3.8	0.3	-1.5	-34.3
투신	46.9	-2.3	44.6	0.0	10.2	-98.1	8.2	0.0	0.0	-9.8
은행+보험+기타금융	-10.3	6.7	-3.6	0.0	-0.6	-69.6	-0.5	2.4	-1.5	0.2
연기금+국가지자체	-57.1	-94.9	-152.1	-1.5	-39.6	1.8	0.0	0.0	0.0	1.2
기타법인	28.2	-30.0	-1.7	0.0	-0.5	14.3	1.7	-0.1	0.3	0.9

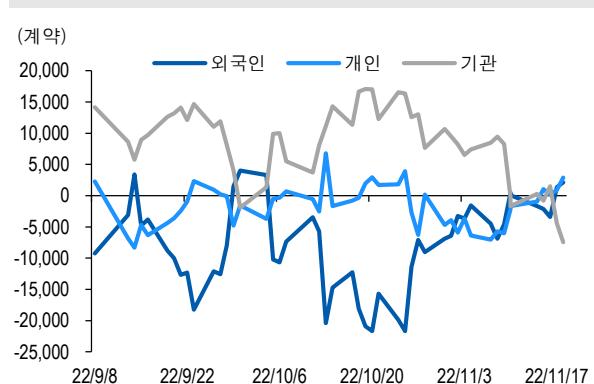
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	778,125	253.6	898,011	16.6%	지수옵션 전체	1,497,836	488.0	2,333,730							
Put	719,711	234.4	1,435,719	19.2%	PCR(금액기준)	0.92	VKOSPI	19.87%(-0.22%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	325.0(K+3)	2.34	-0.75	50,435	18,853	593	16.7	Put	320.0(K+1)	6.72	0.78	9,504	16,309	-95	18.3
	322.5(K+2)	3.15	-0.91	29,813	10,764	627	16.8		317.5(K+0)	5.44	0.59	15,149	8,056	450	18.5
	320.0(K+1)	4.16	-1.06	16,502	18,889	385	17.0		315.0(K-1)	4.32	0.42	26,569	16,166	1,405	18.6
	317.5(K+0)	5.38	-1.20	5,814	7,518	426	17.2		312.5(K-2)	3.46	0.37	37,536	12,124	404	19.1
	315.0(K-1)	6.79	-1.03	2,230	10,287	111	17.4		310.0(K-3)	2.72	0.23	67,295	23,072	52	19.4

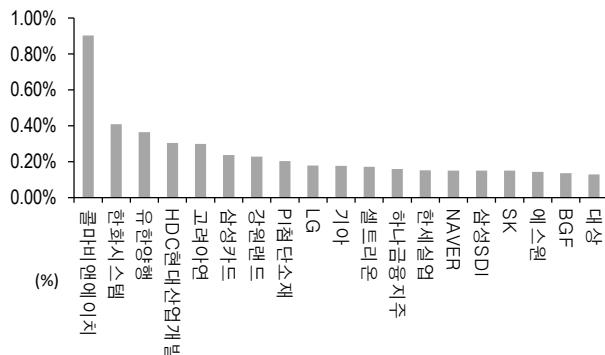
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,014,457	2,016.6	4,692,760	54,318	14,571	48,615	-65,334	0.8	41.0	-42.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수(%)	개인순매수(%)	기관순매수(%)
롯데케미칼	160,500	-5.31	32.7	102.1	31,699	1,176	-1.00%	-842	-1,651	2,648
SK 하이닉스	88,800	0.68	231.5	90.3	165,330	-5,509	0.12%	-5,466	8,369	-2,536
삼성전기	138,500	0.00	57.1	87.1	15,861	-3,202	-0.06%	-461	2,028	-1,587
현대차	169,500	-0.59	74.0	81.3	44,298	-718	0.00%	-2,284	449	1,835
삼성전자	61,800	0.16	582.1	81.0	1,198,474	27,157	0.07%	22,018	21,122	-43,304
일진마티리얼즈	65,400	1.08	10.8	74.6	57,061	-305	-0.03%	60	70	-130
코스맥스	59,600	0.68	2.7	72.1	1,784	-258	-0.04%	-464	-43	507
대한항공	25,250	-1.17	12.6	60.1	65,888	1,043	0.09%	493	195	-688
현대제철	33,050	-1.34	5.8	57.9	12,776	-232	-0.08%	-1,708	781	891
삼성 SDI	703,000	-0.14	63.4	55.4	21,107	-463	0.15%	265	-217	-42

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터