

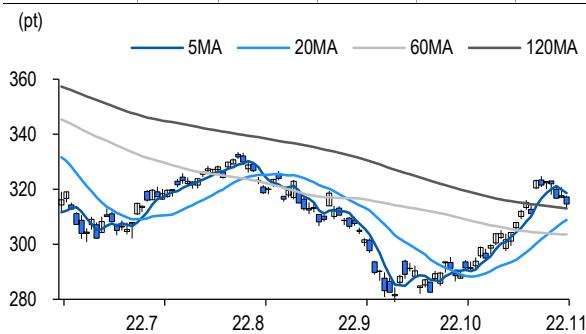


선물옵션시장 지표

2022.11.22

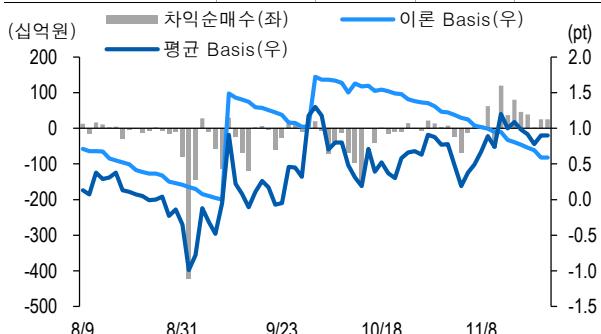
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	314.67	-0.77	-2.45	4,971.0	-
선물 12월물	314.45	-0.95	-3.00	18,874.1	305,709
선물 3월물	312.65	-0.86	-2.70	127.3	20,596
12월물(mini)	314.40	-0.96	-3.08	1,161.9	45,518
1월물(mini)	311.30	-0.80	-2.52	2.4	19,702



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.59	0.90	-0.22	0.10%
베이시스(mini)	0.59	0.90	-0.27	0.10%
제1스프레드(SP)	-1.74	-2.04	-2.00	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.59	-0.11	-0.11	-0.22%



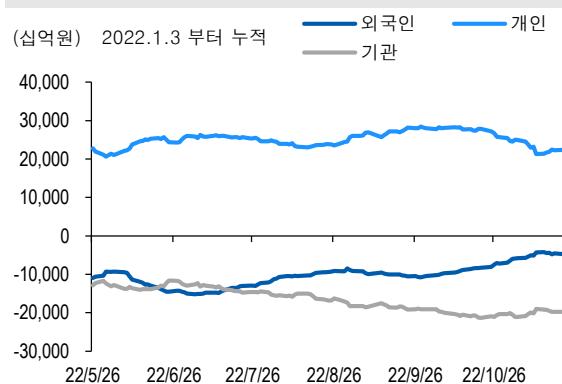
투자주체별 매매 동향

(십억원)

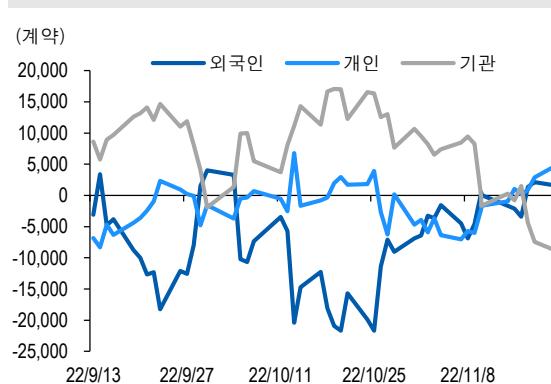
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-162.6	42.4	-120.2	-2.1	15.5	-29.4	-12.9	-2.7	-0.3	25.8
개인	65.7	-0.1	65.6	0.0	0.7	132.1	11.0	0.1	1.0	6.6
기관	79.7	-43.8	35.9	27.7	18.4	-105.6	0.9	2.8	-0.4	-30.1
금융투자	279.9	-17.9	262.1	19.1	74.2	52.6	-0.1	2.9	-0.9	-10.8
투신	-18.4	11.7	-6.6	-0.2	-7.1	-91.9	0.7	-0.1	0.0	-17.3
은행+보험+기타금융	-4.9	-12.1	-17.0	7.3	0.0	-67.1	0.3	0.0	0.5	0.2
연기금+국가지자체	-54.4	-13.9	-68.4	0.0	-39.0	0.8	0.0	0.0	0.0	-2.2
기타법인	17.2	1.6	18.8	0.0	0.0	2.9	1.0	-0.2	-0.3	-2.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

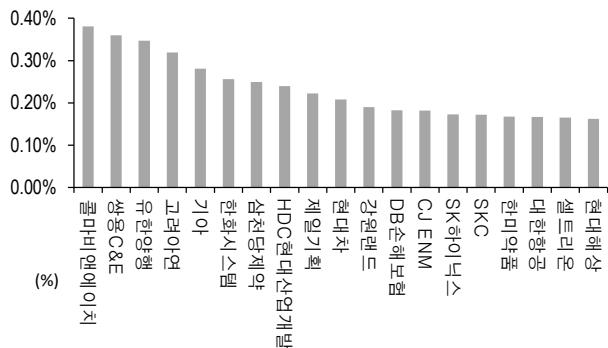
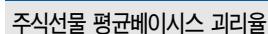
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향									(계약, 십억원)						
	거래량	거래대금	미결제약정		대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정					
Call	655,414	175.1	919,078		16.2%		지수옵션 전체	1,200,925	382.6	2,371,031					
Put	545,511	207.5	1,451,953		19.4%		PCR(금액기준)	1.19	VKOSPI	19.81%(-0.06%p)					
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	1.25	-1.09	72,271	21,913	3,060	16.1	Put	320.0(K+1)	8.08	1.36	1,605	16,169	-140	19.3
	322.5(K+2)	1.86	-1.29	45,953	13,558	2,794	16.3		317.5(K+0)	6.52	1.08	5,871	8,071	15	19.1
	320.0(K+1)	2.60	-1.56	35,374	20,973	2,084	16.3		315.0(K-1)	5.14	0.82	13,708	16,599	433	19.0
	317.5(K+0)	3.58	-1.80	14,980	8,865	1,347	16.4		312.5(K-2)	4.04	0.58	22,247	11,817	-307	19.2
	315.0(K-1)	4.71	-2.08	8,246	11,334	1,047	16.4		310.0(K-3)	3.14	0.42	40,512	25,735	2,663	19.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	2,721,944	1,818.8	4,759,496	66,736	31,584	4,193	-35,465	25.8	6.6	-30.1		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	308,500	-0.16	44.0	92.2	14,302	1,361	0.02%	-470	1,465	-991	-738	-7
롯데케미칼	172,500	7.48	70.2	89.5	28,609	-3,090	-0.61%	-493	1,778	-629	-3,633	-25
삼성전자	61,400	-0.65	496.3	87.9	1,189,040	-9,434	0.10%	-13,511	-12,335	25,646	19,791	2,150
삼성전기	136,500	-1.44	28.2	75.8	16,708	847	-0.03%	709	-64	-567	178	-745
현대제철	32,950	-0.30	5.3	68.6	12,362	-414	-0.08%	-272	-423	695	765	-70
호텔신라	71,700	-0.83	12.0	66.0	10,922	1,337	0.02%	1,973	-95	-1,878	-1,784	-94
한국조선해양	76,800	-2.17	5.1	65.9	4,530	-119	-0.05%	-677	-89	755	730	25
고려아연	651,000	0.00	24.5	63.2	8,567	1,156	0.32%	144	842	-988	-1,082	94
넥센타이어	6,920	0.00	0.7	62.9	1,881	-350	-0.22%	-470	428	42	42	0
SK 하이닉스	86,800	-2.25	112.6	62.3	171,469	6,139	0.17%	3,732	-1,518	-2,200	1,675	-2,253

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터