

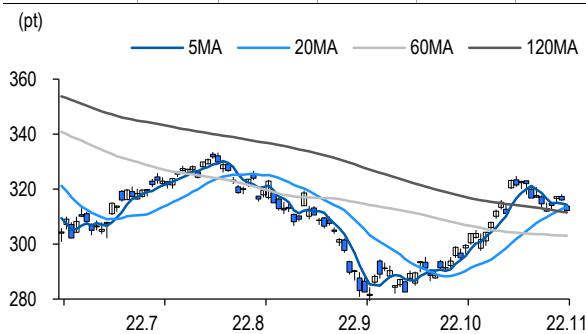


선물옵션시장 지표

2022.11.29

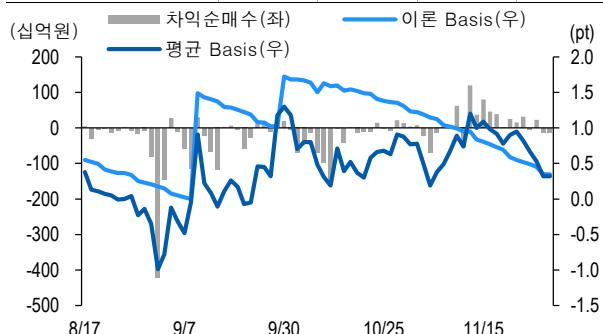
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.21	-1.22	-3.86	4,332.0	-
선물 12월물	312.90	-1.14	-3.60	20,912.3	303,456
선물 3월물	311.35	-1.11	-3.50	155.6	26,492
12월물(mini)	312.90	-1.14	-3.58	1,210.7	45,350
1월물(mini)	309.80	-1.11	-3.48	4.8	22,895



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.34	0.32	0.69	-0.01%
베이시스(mini)	0.34	0.32	0.69	-0.01%
제1스프레드(SP)	-1.74	-1.59	-1.55	0.05%
합성선물 베이시스(ATM)	0.34	0.72	0.72	0.12%



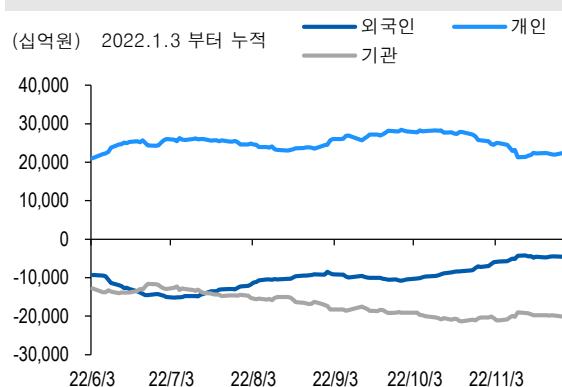
투자주체별 매매 동향

(십억원)

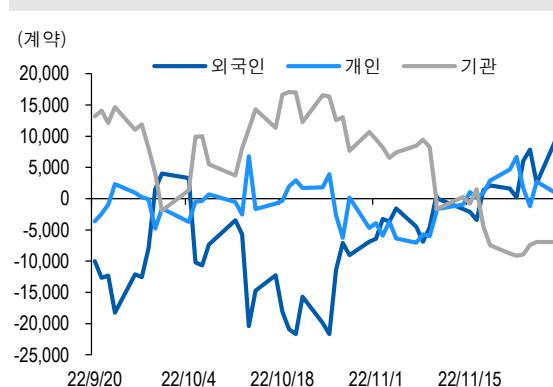
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-121.4	-17.1	-138.6	-11.1	-121.1	583.3	-5.5	1.4	-1.0	-30.1
개인	353.6	21.5	375.0	0.0	-0.6	-154.7	-0.2	-2.7	3.7	-17.0
기관	-266.1	-16.7	-282.8	-1.6	-23.6	-474.7	4.9	1.8	-2.7	44.5
금융투자	-119.0	-46.8	-165.8	-1.6	36.4	-250.0	5.2	1.7	-3.0	48.8
투신	-38.5	10.7	-27.8	0.0	-2.5	-223.8	-0.2	-0.1	0.0	-11.7
은행+보험+기타금융	-12.4	-9.3	-21.8	0.0	-9.0	-1.3	-0.1	0.2	0.3	-0.1
연기금+국가지자체	-67.1	8.7	-58.3	0.0	-42.5	0.3	0.0	0.0	0.0	7.5
기타법인	34.0	12.3	46.3	0.0	-0.1	46.1	0.7	-0.5	0.0	2.5

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	768,870	177.0	1,018,376	16.0%	지수옵션 전체		1,546,416	399.8	2,617,840		
Put	777,546	222.7	1,599,464	16.7%	PCR(금액기준)		1.26	VKOSPI	18.12%(+1.15%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	322.5(K+3)	0.53	-0.74	92,349	24,458	3,666	15.6	317.5(K+1)	6.15	2.11	2,761
	320.0(K+2)	0.97	-1.04	130,382	29,225	283	16.0	315.0(K+0)	4.65	1.78	16,219
	317.5(K+1)	1.62	-1.43	80,614	14,712	924	16.3	312.5(K-1)	3.37	1.38	38,576
	315.0(K+0)	2.58	-1.82	69,304	16,932	2,514	16.9	310.0(K-2)	2.35	1.00	76,984
	312.5(K-1)	3.81	-2.20	24,637	9,090	2,443	17.4	307.5(K-3)	1.65	0.74	68,075
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	322.5(K+3)	0.53	-0.74	92,349	24,458	3,666	15.6	317.5(K+1)	6.15	2.11	2,761
	320.0(K+2)	0.97	-1.04	130,382	29,225	283	16.0	315.0(K+0)	4.65	1.78	16,219
	317.5(K+1)	1.62	-1.43	80,614	14,712	924	16.3	312.5(K-1)	3.37	1.38	38,576
	315.0(K+0)	2.58	-1.82	69,304	16,932	2,514	16.9	310.0(K-2)	2.35	1.00	76,984
	312.5(K-1)	3.81	-2.20	24,637	9,090	2,443	17.4	307.5(K-3)	1.65	0.74	68,075

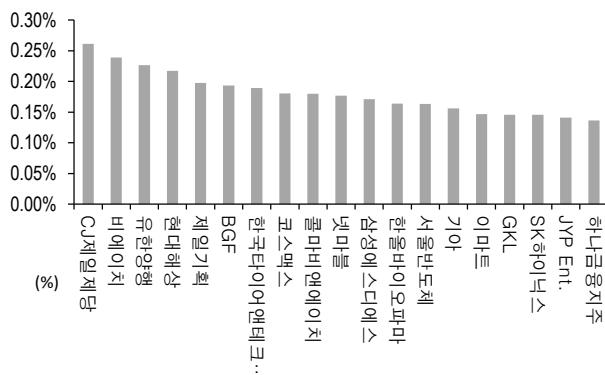
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	금융투자	연기금등	순매수
주식선물 전체	2,521,207	1,665.6	4,995.177	-18,223	-68,298	-17,433	82,140	-30.1	-17.0	44.5			
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수	
넥센타이어	6,960	-1.42	0.8	99.8	2,779	515	-0.14%	191	268	-459	-459	0	
롯데케미칼	175,500	-0.57	12.7	78.7	24,491	-256	-0.17%	-1,201	783	391	-57	347	
삼성전기	132,500	-1.49	25.9	77.1	15,461	-955	0.02%	197	53	-200	-709	499	
SK 이노베이션	175,500	-0.57	63.4	76.6	21,098	-3,132	-0.04%	-1,392	-1,687	3,299	1,509	1,502	
현대차	168,000	0.90	63.1	68.6	41,020	-1,113	0.08%	-1,417	-1,004	2,488	1,458	1,030	
일진마티리얼즈	60,300	-1.63	6.9	68.4	49,052	-986	0.06%	-1,157	-13	1,170	941	229	
삼성전자	60,200	-1.31	352.2	68.4	1,111,231	-50,363	0.02%	1,100	-7,954	2,671	1,769	550	
코스맥스	58,100	-0.85	1.7	64.5	1,723	70	0.18%	460	-11	-459	-459	0	
LG 전자	93,600	4.23	87.7	63.1	31,179	3,980	0.06%	-1,110	2,633	-1,792	-936	270	
현대제철	32,600	-2.10	6.8	62.2	12,292	-201	0.00%	1,005	-199	-804	-404	-400	

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터