

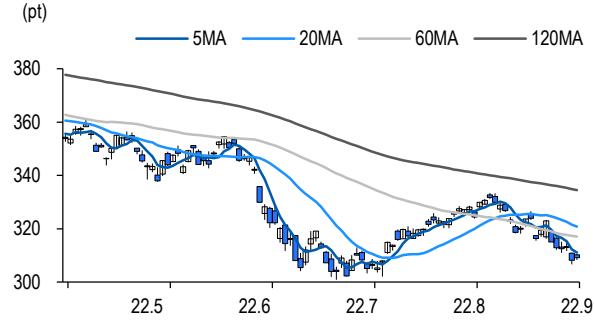


선물옵션시장 지표

2022.9.13

Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	309.12	0.31	0.96	6,299.2	-
선물 9월물	309.10	0.26	0.80	14,065.8	0
선물 12월물	309.35	0.42	1.30	10,658.4	278,105
9월물(mini)	309.02	0.23	0.76	587.9	0
10월물(mini)	308.30	0.13	0.40	1,186.6	60,353



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.00	-0.05	-0.02	-0.02%
베이시스(mini)	0.00	-0.05	-0.10	-0.02%
제1스프레드(SP)	1.55	0.25	0.30	-0.42%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	-0.03	-0.03	-0.01%



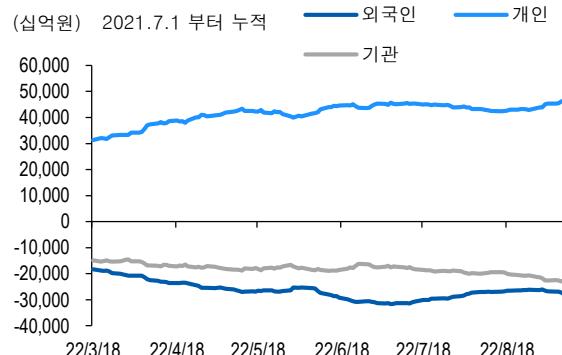
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-651.4	85.1	-566.2	-88.3	-280.2	254.3	-113.7	8.4	-4.6	-3.8
개인	141.1	-54.0	87.1	0.0	-0.3	-163.7	6.4	-0.8	0.6	14.8
기관	500.4	-29.7	470.7	-25.0	-21.6	205.1	105.5	-4.6	4.1	-11.4
금융투자	477.8	5.5	483.3	-15.9	45.5	-80.7	106.1	-1.6	4.4	-15.2
투신	25.0	-20.8	4.2	0.0	-11.9	188.8	-0.5	-2.2	-0.1	43.5
은행+보험+기타금융	8.0	-1.8	6.2	0.0	0.0	26.7	-0.2	-0.8	-0.3	-0.1
연기금+국가지자체	-58.2	-0.3	-58.6	-9.2	-50.9	70.2	0.0	0.0	0.0	-39.7
기타법인	9.9	-1.4	8.5	0.0	0.2	-295.8	1.8	-2.9	-0.1	0.4

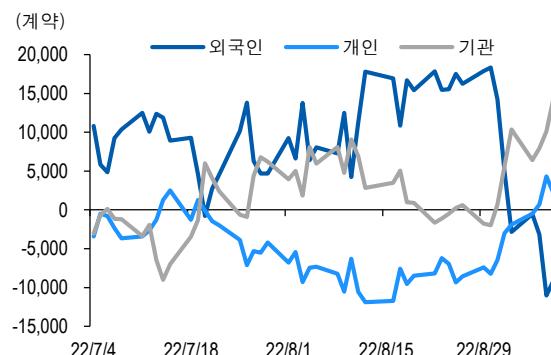
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,476,383	368.2	600,531	9.5%	지수옵션 전체	4,715,719	715.4	1,505,622
Put	2,239,336	347.2	905,091	10.1%	PCR(금액기준)	0.94	VKOSPI	19.17%(-0.68%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	315.0(K+3)	0.01	-0.07	133,236	0	-42,860	15.7	Put
	312.5(K+2)	0.03	-0.18	683,581	0	-50,336	11.7	
	310.0(K+1)	0.14	-0.65	1,113,184	0	-30,706	6.8	
	307.5(K+0)	1.63	-0.35	314,729	0	-16,309	10.1	
	305.0(K-1)	4.10	0.25	28,694	0	-6,346	18.9	

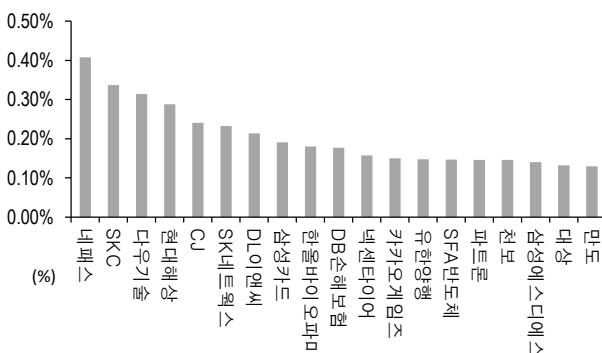
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,900,590	3,295.1	3,526,858	-1,691,785	16,141	52,774	-67,340	-3.8	14.8	-11.4
<hr/>										
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	200,000	-1.23	120.6	70.4	0	-34,175	-0.14%	-3,472	497	2,936
삼성전기	138,000	1.85	24.8	47.5	0	-19,871	-0.09%	262	-924	670
포스코인터내셔널	25,550	-2.67	11.8	43.2	0	-60,321	-0.07%	2,463	-214	-2,236
삼성전자	55,800	-0.53	404.6	40.8	0	-551,483	-0.03%	29,322	18,478	-47,640
한화솔루션	53,900	1.70	81.7	40.2	0	-108,613	-0.10%	-4,199	-676	5,474
씨젠	30,450	0.33	4.7	35.1	0	-23,759	0.06%	2,418	-344	-1,634
SK 하이닉스	90,600	0.00	59.8	33.5	0	-152,254	-0.01%	-4,400	2,962	1,433
일진마티리얼즈	66,500	1.53	6.2	32.7	0	-32,217	-0.05%	900	-415	-485
셀트리온	183,500	2.51	24.2	26.1	0	-18,670	-0.04%	-2,927	467	2,460
LG 화학	640,000	2.56	43.2	26.0	0	-6,132	-0.23%	-648	-406	1,039

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터