

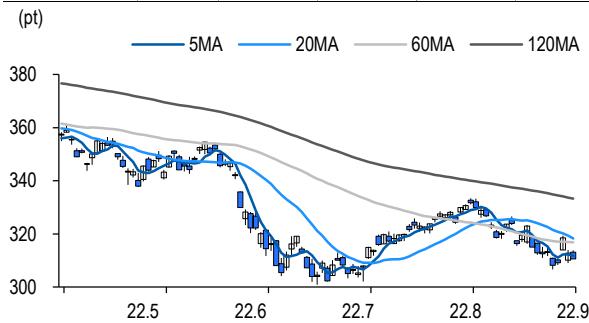


선물옵션시장 지표

2022.9.16

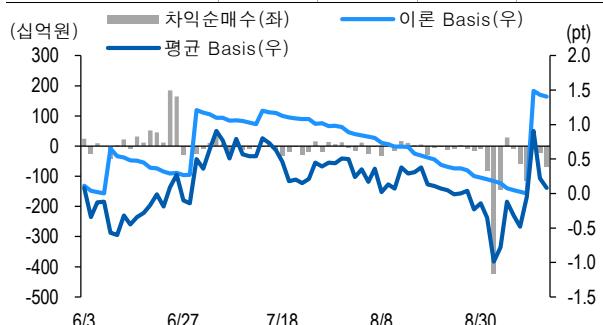
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	310.63	-0.67	-2.11	5,379.9	-
선물 12월물	311.40	-0.42	-1.30	20,387.1	294,503
선물 3월물	309.45	-0.47	-1.45	17.6	5,761
10월물(mini)	310.74	-0.43	-1.34	1,457.3	83,129
11월물(mini)	310.62	-0.60	-1.88	3.3	6,942



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.41	0.08	0.77	-0.43%
베이시스(mini)	0.71	-0.58	0.11	-0.41%
제1스프레드(SP)	-2.60	-1.92	-1.90	0.22%
합성선물 베이시스(ATM)	0.71	0.13	0.13	-0.19%



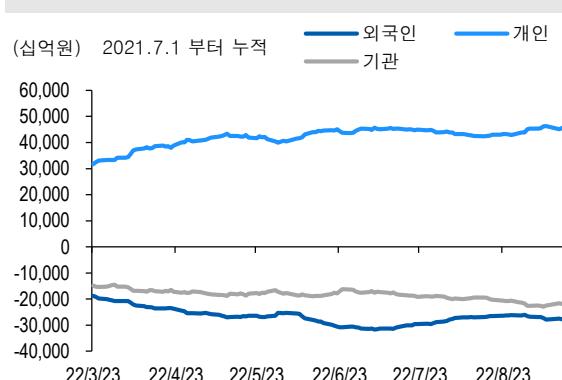
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-223.1	9.8	-213.3	-3.1	-205.5	-577.8	-65.2	3.9	-5.4	13.4
개인	349.9	70.5	420.4	0.0	-0.5	260.1	22.8	0.3	-1.6	19.0
기관	-144.0	-78.2	-222.3	-63.9	-1.7	206.2	40.7	-3.8	6.6	-33.7
금융투자	-203.3	-106.0	-309.3	-40.6	-0.4	296.7	40.6	-3.6	6.6	-29.7
투신	7.9	2.3	10.2	0.0	-6.8	-89.3	0.1	-0.2	0.0	-6.1
은행+보험+기타금융	12.8	0.4	13.3	0.0	4.2	6.6	0.0	0.0	0.0	0.1
연기금+국가지자체	29.4	0.5	29.9	1.5	4.9	-7.8	0.0	0.0	0.0	2.1
기타법인	17.2	-2.0	15.1	0.0	0.1	111.5	1.7	-0.4	0.4	1.2

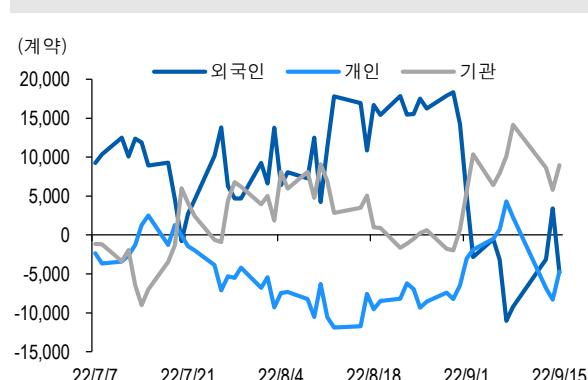
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



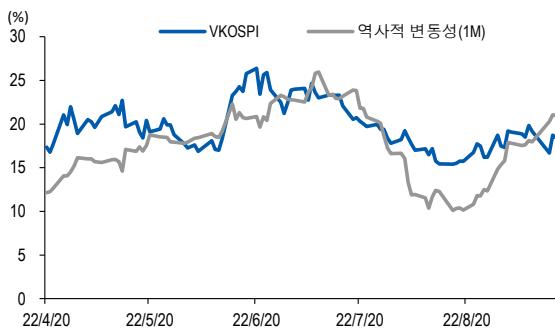
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	601,598	174.2	774,984	15.7%	지수옵션 전체	1,246,640	407.7	2,085,878
Put	645,042	233.4	1,310,894	17.5%	PCR(금액기준)	1.34	VKOSPI	18.39%(-0.34%p)
<hr/>								
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	320.0(K+3)	2.06	-0.64	51,215	20,963	1,884	15.6	315.0(K+1)
	317.5(K+2)	2.88	-0.75	19,367	11,594	572	16.0	312.5(K+0)
	315.0(K+1)	3.85	-0.86	12,444	10,320	-451	16.4	310.0(K-1)
	312.5(K+0)	5.02	-0.95	7,608	6,872	-136	16.9	307.5(K-2)
	310.0(K-1)	6.35	-1.06	6,242	5,791	1,800	17.3	305.0(K-3)
<hr/>								
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	315.0(K+1)	8.10	0.49	3,928	8,338	-13	16.1	
	312.5(K+0)	6.76	0.38	7,014	7,746	393	16.6	
	310.0(K-1)	5.61	0.30	16,781	20,475	1,220	17.0	
	307.5(K-2)	4.60	0.21	16,938	15,232	1,405	17.4	
	305.0(K-3)	3.76	0.14	25,197	20,460	769	17.9	

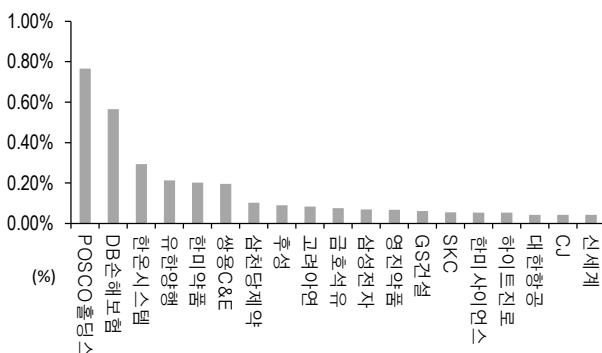
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,846,343	1,917.8	3,868,356	114,005	51,900	24,206	-77,642	13.4	19.0	-33.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	199,500	-0.25	63.5	79.4	45,131	987	-0.08%	2,412	506	-3,268
삼성전자	56,000	-1.41	459.9	71.2	1,097,945	38,269	0.07%	44,787	-5,270	-39,697
일진마티리얼즈	67,600	1.20	11.0	67.8	46,930	89	-0.07%	799	-773	-26
SK 하이닉스	92,100	-0.97	101.0	63.2	160,311	-994	-0.46%	-6,129	-109	6,255
현대건설	44,700	3.11	23.4	62.8	20,082	6,294	0.00%	3,795	-1,569	-2,208
메리츠증권	4,560	-0.65	2.0	60.9	45,660	4,106	-0.24%	3,799	-140	-3,659
유한양행	55,800	0.00	2.2	60.6	16,556	3,213	0.21%	-597	3,249	-2,652
KB 금융	49,450	0.41	21.2	59.9	26,498	-2,749	-0.99%	3,304	5,093	-8,372
삼성 SDI	615,000	0.00	87.1	54.9	13,883	1,368	-0.12%	-2,017	629	1,372
LG 화학	660,000	-0.60	64.6	54.9	8,828	321	-0.15%	-32	175	-158

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터