

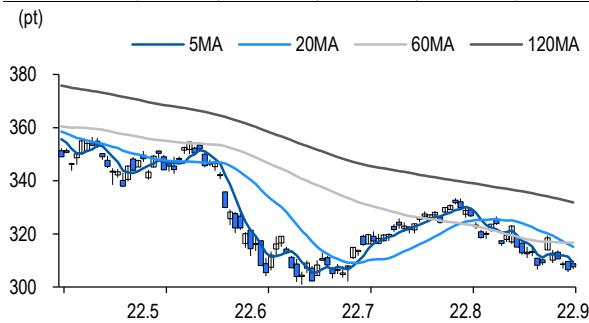


선물옵션시장 지표

2022.9.21

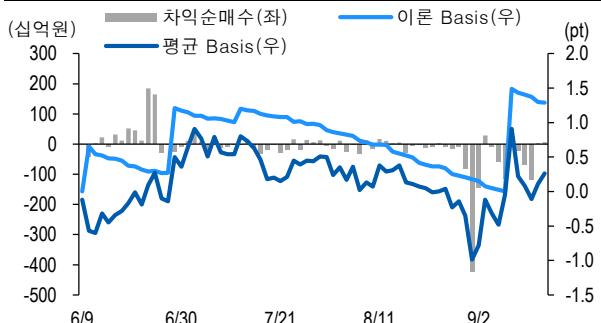
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	307.54	0.34	1.05	4,935.4	-
선물 12월물	307.55	0.21	0.65	18,007.6	300,249
선물 3월물	305.70	0.31	0.95	18.3	6,579
10월물(mini)	306.82	0.22	0.66	1,329.6	82,427
11월물(mini)	307.30	0.24	0.74	4.0	6,836



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.29	0.26	0.01	-0.33%
베이시스(mini)	0.58	-0.47	-0.72	-0.34%
제1스프레드(SP)	-2.59	-1.90	-1.90	0.22%
합성선물 베이시스(ATM)	0.58	-0.71	-0.71	-0.42%



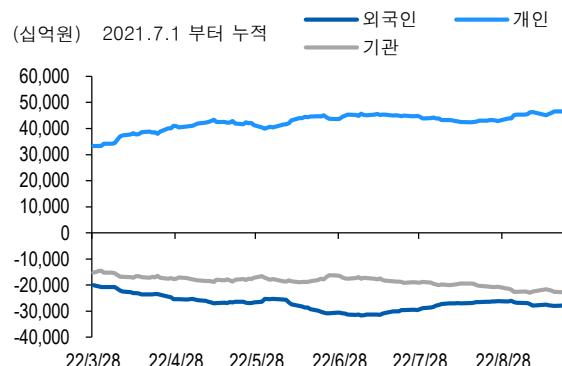
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-77.0	13.5	-63.5	0.4	64.3	-42.9	-52.5	0.2	-1.9	30.1
개인	-224.8	-25.5	-250.3	0.0	0.0	47.8	12.7	1.0	-0.5	-22.3
기관	283.2	11.0	294.2	5.9	23.8	-0.2	39.8	-1.1	2.0	-9.0
금융투자	260.4	8.3	268.7	4.3	-0.4	-195.3	39.7	-0.9	2.6	1.3
투신	14.0	-16.9	-2.8	0.0	6.5	202.4	0.0	-0.2	0.0	-7.6
은행+보험+기타금융	-5.0	14.7	9.7	0.0	-2.9	15.3	0.0	0.0	-0.6	0.3
연기금+국가지자체	32.1	8.0	40.2	1.6	21.7	-22.6	0.0	0.0	0.0	-3.0
기타법인	18.6	1.1	19.7	0.0	-0.7	-4.7	0.0	-0.1	0.5	1.3

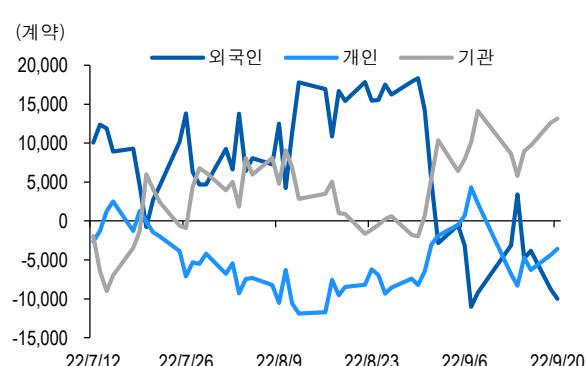
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



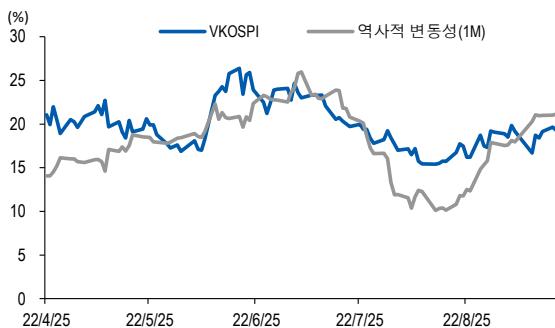
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)									
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정	
Call	514,784	156.1	891,656	15.7%	지수옵션 전체		1,100,908	351.7	2,302,968
Put	586,124	195.7	1,411,312	19.5%	PCR(금액기준)		1.25	VKOSPI	19.28%(-0.36%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	315.0(K+3)	2.10	0.02	55,641	20,312	3,284	15.7	310.0(K+1)	7.17
	312.5(K+2)	2.94	0.03	24,334	11,721	1,543	16.0	307.5(K+0)	5.86
	310.0(K+1)	3.99	0.14	13,255	9,334	955	16.4	305.0(K-1)	4.79
	307.5(K+0)	5.19	0.16	6,819	5,356	699	16.6	302.5(K-2)	3.86
	305.0(K-1)	6.59	0.20	2,154	3,223	193	16.9	300.0(K-3)	3.09
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	310.0(K+1)	7.17	-0.50	5,356	20,956	-66	18.4	307.5(K+0)	5.86
	307.5(K+0)	5.86	-0.51	7,866	17,156	425	18.6	305.0(K-1)	4.79
	305.0(K-1)	4.79	-0.43	13,132	21,577	277	19.0	302.5(K-2)	3.86
	302.5(K-2)	3.86	-0.39	15,518	16,570	770	19.3	300.0(K-3)	3.09
	300.0(K-3)	3.09	-0.36	36,359	21,843	39	19.7		

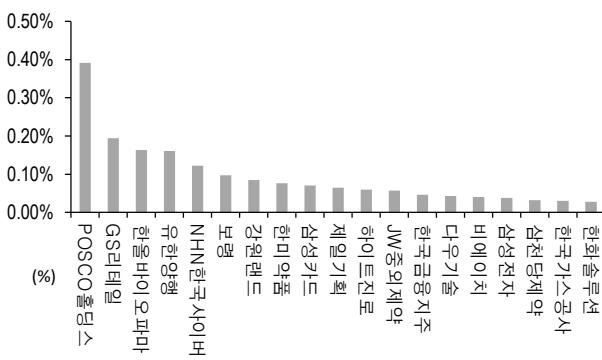
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,819,018	1,903.6	3,971,164	81,721	84,672	-29,717	-62,617	30.1	-22.3	-9.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	198,500	-1.49	130.2	94.3	48,905	2,446	0.01%	-2,052	1,647	578
삼성전자	55,600	-0.71	559.6	71.8	1,121,057	21,492	0.04%	12,493	1,054	-13,600
LG 화학	629,000	-0.94	59.6	62.7	8,635	218	-0.11%	192	-81	-115
한화슬루션	50,800	0.59	56.0	62.6	115,688	333	0.03%	-1,078	-897	2,003
한화에어로	74,600	1.22	44.9	54.4	23,749	-3,769	-0.32%	220	-1,032	832
일진마티리얼즈	63,200	0.00	10.3	54.2	43,784	571	0.02%	1,124	119	-1,313
SK 이노베이션	179,500	1.41	25.7	52.8	11,302	-42	-0.06%	-51	131	-80
현대건설	44,450	2.30	9.4	51.8	18,774	563	-0.07%	773	-357	-416
삼성전기	127,500	-1.16	35.9	49.8	35,313	818	-0.09%	-70	752	-701
현대제철	34,000	1.49	8.5	49.7	17,448	1,725	-0.07%	4,132	-1,105	-3,076

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터