

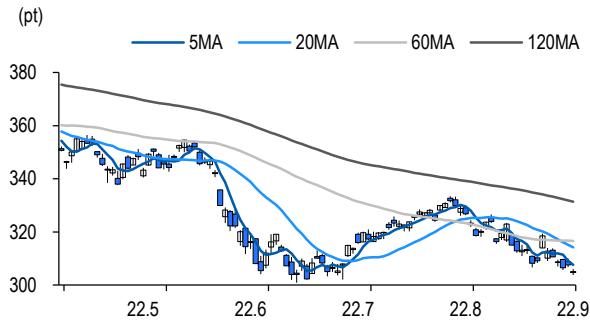


## 선물옵션시장 지표

2022.9.22

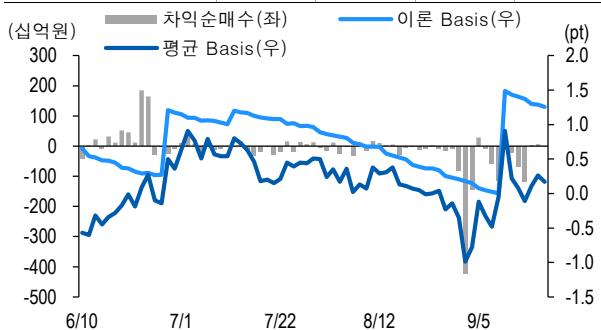
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	304.67	-0.93	-2.87	4,591.5	-
선물 12월물	304.40	-1.02	-3.15	20,096.0	308,284
선물 3월물	302.55	-1.03	-3.15	16.7	6,622
10월물(mini)	303.72	-1.01	-3.10	1,456.1	80,540
11월물(mini)	304.00	-1.07	-3.30	9.6	6,772



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.26	0.17	-0.27	-0.36%
베이시스(mini)	0.55	-0.52	-0.95	-0.35%
제1스프레드(SP)	-2.59	-1.88	-1.95	0.23%
합성선물 베이시스(ATM)	0.55	-0.99	-0.99	-0.51%



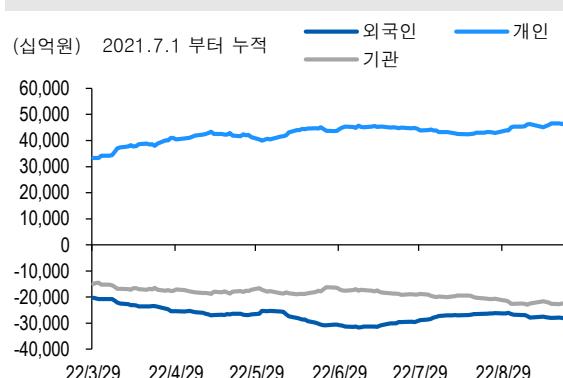
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-275.8	7.3	-268.5	-5.5	-129.5	-157.5	-44.9	0.4	-1.6	-1.3
개인	329.2	20.3	349.5	0.0	-1.3	80.8	9.9	-0.8	2.1	12.0
기관	-67.5	-31.2	-98.7	1.7	-5.6	38.6	33.0	1.1	-1.1	-10.1
금융투자	-17.6	-56.7	-74.3	0.1	-3.3	295.9	35.9	2.2	-1.0	-10.6
투신	8.8	1.1	10.0	0.0	2.8	-252.3	-2.9	-0.4	0.0	-3.0
은행+보험+기타금융	1.8	10.2	12.0	0.0	-1.0	18.8	0.0	-0.6	-0.1	0.1
연기금+국가지자체	-42.6	20.2	-22.3	1.6	-3.6	-23.8	0.0	0.0	0.0	3.4
기타법인	14.1	3.6	17.6	0.0	-0.9	38.2	2.0	-0.7	0.5	-0.6

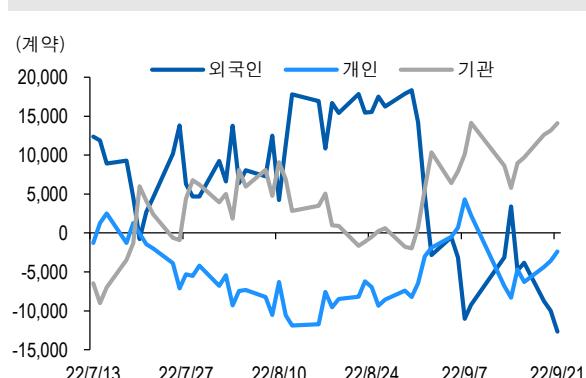
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



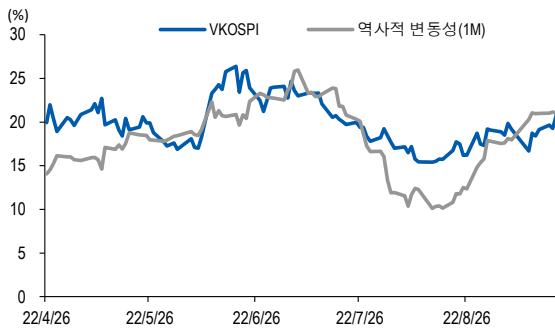
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	590,773	158.8	936,218	16.7%	지수옵션 전체	1,201,329	398.8	2,399,454
Put	610,556	240.0	1,463,236	20.8%	PCR(금액기준)	1.51	VKOSPI	20.80% (+1.52%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	315.0(K+3)	1.53	-0.57	66,181	24,627	4,315	16.6	310.0(K+1)
	312.5(K+2)	2.20	-0.74	44,310	13,143	1,422	17.0	307.5(K+0)
	310.0(K+1)	3.02	-0.97	25,882	12,365	3,031	17.3	305.0(K-1)
	307.5(K+0)	3.97	-1.22	15,302	6,970	1,614	17.4	302.5(K-2)
	305.0(K-1)	5.15	-1.44	8,318	5,784	2,561	17.6	300.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	310.0(K+1)	9.26	2.09	6,165	21,291	335	20.0	307.5(K+0)
	307.5(K+0)	7.79	1.93	6,293	17,417	261	20.3	305.0(K-1)
	305.0(K-1)	6.42	1.63	10,995	22,529	952	20.3	302.5(K-2)
	302.5(K-2)	5.29	1.43	12,276	17,654	1,084	20.6	300.0(K-3)
	300.0(K-3)	4.35	1.26	23,459	20,864	-979	21.1	

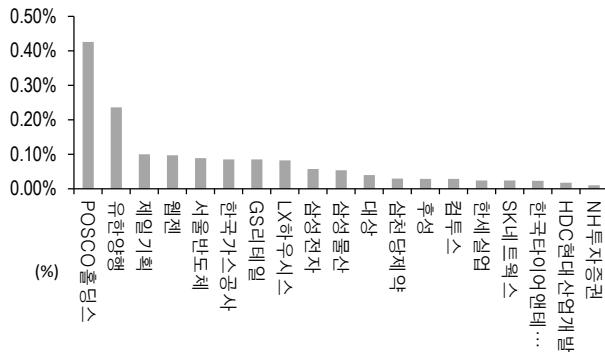
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	2,584,970	1,632.3	4,040,624	69,460	-15,250	19,145	-3,551	-1.3	12.0	-10.1
<hr/>										
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	197,000	-0.76	108.6	89.5	47,919	-986	0.00%	4,259	586	-4,485
LG 화학	626,000	-0.48	60.8	74.5	8,724	89	-0.07%	-136	49	104
한화솔루션	49,350	-2.85	79.4	64.0	120,045	4,357	-0.02%	7,318	-1,786	-5,461
일진머티리얼즈	62,300	-1.42	8.5	61.3	44,396	612	-0.05%	-700	617	83
SK 이노베이션	178,500	-0.56	27.6	58.2	11,371	69	-0.11%	1,310	-72	-1,254
엔씨소프트	358,500	1.41	9.3	55.9	6,777	217	-0.09%	333	-16	-317
SK 하이닉스	87,900	0.00	141.4	55.0	174,335	1,586	-0.28%	14,329	2,247	-16,620
한화시스템	13,750	-1.08	3.4	55.0	28,313	17,103	-0.71%	4,598	-14,317	9,509
삼성전자	54,900	-1.26	347.0	53.3	1,143,258	22,201	0.06%	-11,189	22,060	-10,907
LG 이노텍	344,000	-0.15	24.7	51.1	7,912	359	-0.13%	98	-134	43

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터