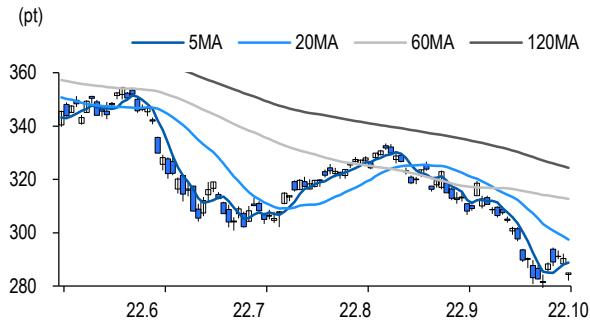


선물옵션시장 지표

2022.10.12

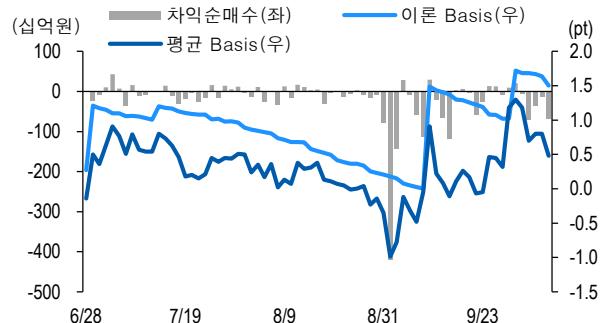
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	284.96	-1.88	-5.45	5,954.2	-
선물 12월물	284.90	-2.05	-5.95	24,868.5	338,214
선물 3월물	283.05	-2.02	-5.85	36.6	13,011
10월물(mini)	284.22	-2.01	-5.82	1,789.4	114,187
11월물(mini)	284.56	-2.04	-5.94	90.7	12,105



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.50	0.48	-0.06	-0.36%
베이시스(mini)	0.05	-0.37	-0.74	-0.15%
제1스프레드(SP)	-2.51	-2.17	-2.25	0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	0.05	-0.80	-0.80	-0.30%



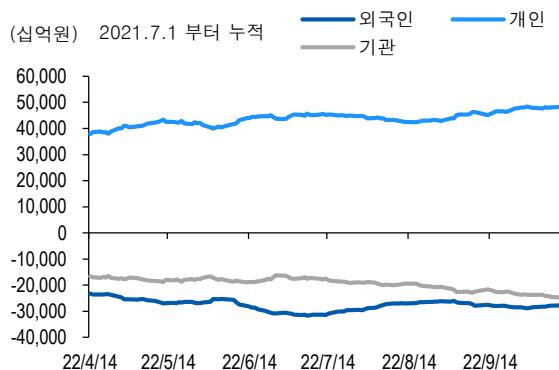
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	197.5	-25.3	172.1	-13.4	213.5	265.7	12.7	7.3	-4.3	-46.6
개인	108.2	66.9	175.1	0.0	-0.8	-101.2	10.5	-7.4	11.5	-14.4
기관	-309.7	-39.2	-348.9	-55.5	33.8	-110.2	-21.0	1.8	-11.6	61.8
금융투자	-294.7	-79.9	-374.6	-20.1	-0.5	268.1	-21.0	4.0	-11.2	79.9
투신	-38.4	2.2	-36.2	0.0	5.4	-396.9	0.0	-0.2	0.3	-25.6
은행+보험+기타금융	4.5	-11.2	-6.7	0.0	-1.1	12.6	0.0	-2.0	-0.7	0.3
연기금+국가지자체	138.9	10.8	149.7	-1.4	28.6	6.0	0.0	0.0	0.0	7.3
기타법인	4.1	-2.4	1.7	0.0	-0.2	-54.3	-2.1	-1.7	4.5	-0.9

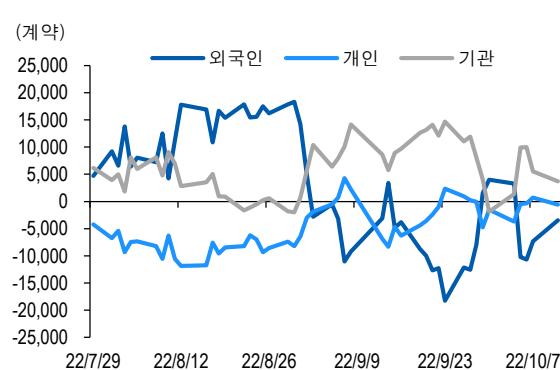
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,123,376	342.7	1,772,423	21.0%	지수옵션 전체	4,209,376	933.7	3,843,197							
Put	2,086,000	591.1	2,070,774	27.0%	PCR(금액기준)	1.73	VKOSPI	25.78% (+1.85%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	297.5(K+3)	0.06	-0.57	121,999	38,784	4,672	24.1	Put	292.5(K+1)	8.41	4.00	8,431	18,493	-1,522	33.3
	295.0(K+2)	0.12	-1.06	240,767	48,002	13,521	22.8		290.0(K+0)	6.34	3.29	15,949	30,510	-1,661	31.6
	292.5(K+1)	0.22	-1.76	305,203	42,281	14,404	21.0		287.5(K-1)	4.31	2.28	25,037	19,780	-2,648	28.2
	290.0(K+0)	0.50	-2.63	454,010	46,977	23,516	20.4		285.0(K-2)	2.76	1.45	84,967	29,587	-4,934	27.0
	287.5(K-1)	1.06	-3.55	330,382	23,762	12,936	19.9		282.5(K-3)	1.67	0.86	225,826	35,423	-14,996	26.8

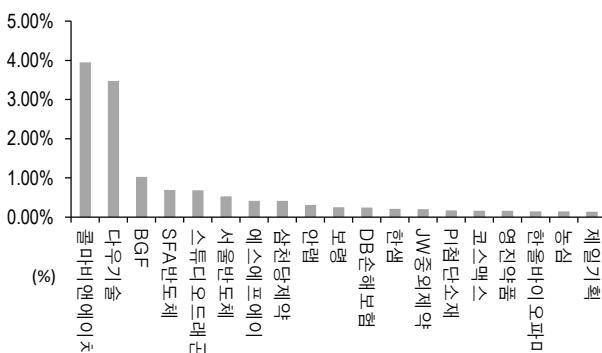
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	5,270,151	3,273.4	4,531,964	146,645	-133,320	44,537	88,037	-46.6	-14.4	61.8
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	168,000	-4.27	143.9	75.1	44,723	3,403	0.11%	4,530	-1,456	-3,074
삼성전기	117,500	-0.84	26.1	72.6	25,914	-1,935	-0.07%	1,808	77	-1,874
SK 하이닉스	90,100	-0.77	247.0	72.1	142,120	-38,984	-0.26%	-465	-15,696	16,335
삼성전자	55,200	-1.60	708.7	60.8	704,560	-339,997	-0.10%	-33,810	40,614	-5,560
하나금융지주	36,750	-2.91	28.1	60.6	78,861	-2,358	0.03%	-4,463	3,872	546
LG 전자	78,500	-3.92	37.1	57.6	19,841	-6,284	0.13%	-3,109	15,487	-12,428
KB금융	44,650	-2.83	31.4	57.1	22,298	-1,703	-0.01%	-2,851	1,180	1,702
LG화학	595,000	0.85	60.8	56.6	7,384	-598	-0.20%	-574	-303	884
엔씨소프트	335,000	-2.90	17.8	56.5	5,757	-355	-0.13%	-113	35	78
한화솔루션	46,250	-2.53	45.9	56.5	58,842	-6,117	0.02%	5,914	-1,883	-4,006

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터