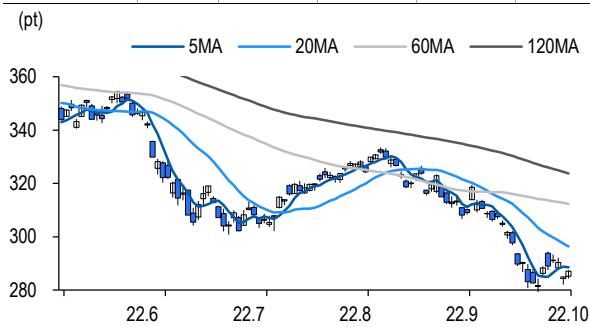


선물옵션시장 지표

2022.10.13

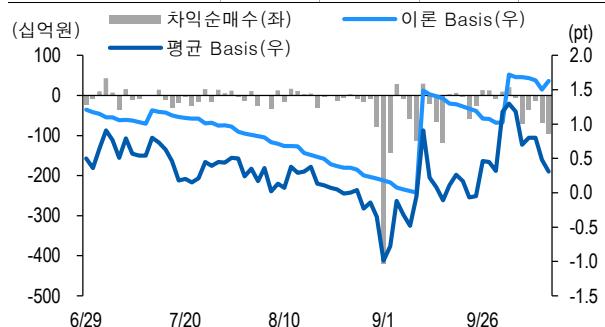
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	287.09	0.75	2.13	5,510.9	-
선물 12월물	287.85	1.04	2.95	25,268.4	331,991
선물 3월물	285.80	0.97	2.75	23.2	13,062
10월물(mini)	287.28	1.08	3.06	1,885.7	126,196
11월물(mini)	287.88	1.17	3.32	152.1	22,581



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.63	0.31	0.76	-0.46%
베이시스(mini)	0.03	-0.38	0.19	-0.14%
제1스프레드(SP)	-2.49	-2.17	-2.15	0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	0.03	0.14	0.14	0.04%



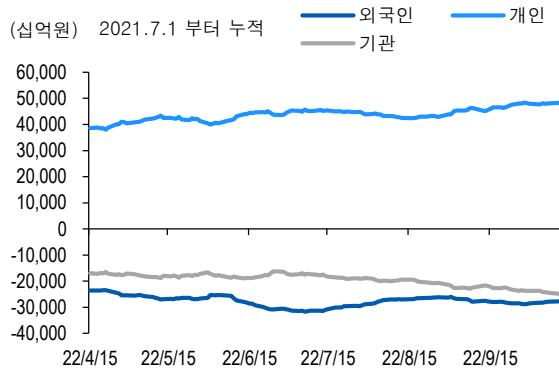
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	238.5	-34.3	204.2	-16.7	134.5	-148.6	-13.3	3.7	-0.5	-31.0
개인	-146.5	49.9	-96.6	0.0	-0.6	-114.4	-27.8	-0.6	-1.1	12.4
기관	-105.0	-17.0	-122.0	-80.1	-73.1	266.5	44.3	-1.8	3.2	20.7
금융투자	-78.5	-76.8	-155.2	-32.7	-16.2	0.2	45.6	-1.7	3.2	4.7
투신	30.5	-2.5	28.0	0.0	1.6	250.1	-0.2	-0.1	-0.1	21.1
은행+보험+기타금융	11.5	5.8	17.3	0.0	-3.1	24.1	-1.1	0.0	0.1	-0.1
연기금+국가지자체	-27.8	3.2	-24.7	-0.1	-58.9	-7.8	0.0	0.1	-0.1	-5.0
기타법인	13.0	1.5	14.5	0.0	-0.6	-3.4	-3.2	-1.3	-1.5	-2.1

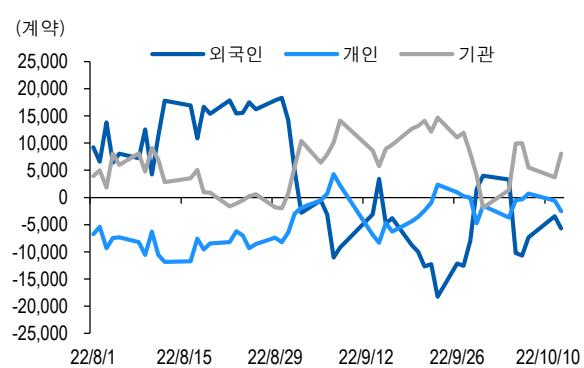
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,260,927	399.7	1,831,931	18.0%	지수옵션 전체	4,501,416	768.5	4,022,886						
Put	2,240,489	368.8	2,190,955	20.3%	PCR(금액기준)	0.92	VKOSPI	24.69%(-1.09%p)						
<hr/>														
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
	292.5(K+3)	0.13	-0.09	359,887	53,298	11,017	17.5	Put						
	290.0(K+2)	0.47	-0.03	700,898	44,392	-2,585	17.4	287.5(K+1)	1.62	-2.69	76,654	23,306	3,526	16.9
	287.5(K+1)	1.37	0.31	516,058	26,327	2,565	18.2	285.0(K+0)	0.68	-2.08	242,420	34,977	5,390	18.0
	285.0(K+0)	2.91	0.86	258,126	20,595	-734	19.2	282.5(K-1)	0.23	-1.44	464,292	47,660	12,237	18.7
	282.5(K-1)	4.98	1.53	49,540	12,169	1,461	21.1	280.0(K-2)	0.08	-0.82	507,205	64,627	8,990	20.2
<hr/>														
277.5(K-3)														

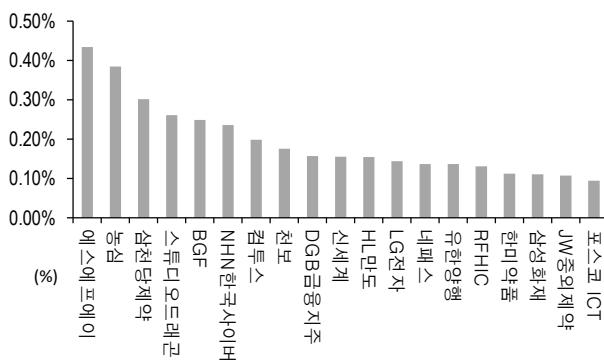
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	5,323,457	3,346.0	4,612,932	80,968	3,708	-20,433	20,281	-31.0	12.4	20.7	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
현대차	167,500	-0.30	112.6	82.3	35,098	-9,625	0.04%	-2,701	2,432	2,400	1,581
SK 이노베이션	157,500	0.64	36.5	80.3	11,674	-817	-0.03%	-349	-1,081	1,430	1,337
엔씨소프트	337,500	0.75	16.0	76.6	3,834	-1,923	0.01%	216	-50	-166	-196
삼성전자	55,800	1.09	757.0	73.4	503,976	-200,584	-0.12%	-21,323	25,387	-4,979	-11,157
삼성전기	117,000	-0.43	41.4	72.9	22,758	-3,156	-0.06%	218	-205	-22	213
현대제철	30,450	1.84	8.5	69.0	8,893	-3,938	0.00%	3,456	-1,456	-2,000	-2,122
대한항공	21,900	3.06	19.5	68.7	78,507	-38,450	-0.12%	3,402	-4,100	2,098	-10,049
SK 하이닉스	93,900	4.22	293.7	68.3	95,060	-47,060	-0.22%	-10,439	-93	10,568	3,650
NAVER	162,500	2.85	160.8	65.9	37,970	-5,459	-0.04%	-2,521	430	1,963	993
한국조선해양	77,200	1.18	6.4	64.5	3,920	259	-0.07%	978	-1,152	174	273

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터