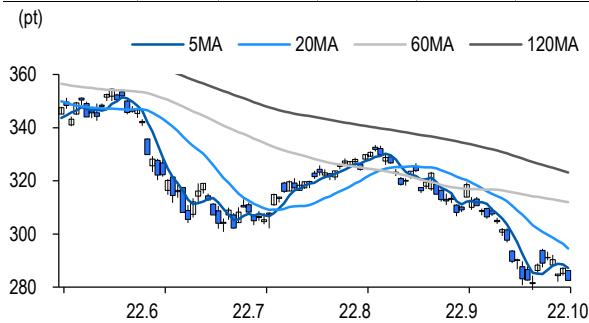


선물옵션시장 지표

2022.10.14

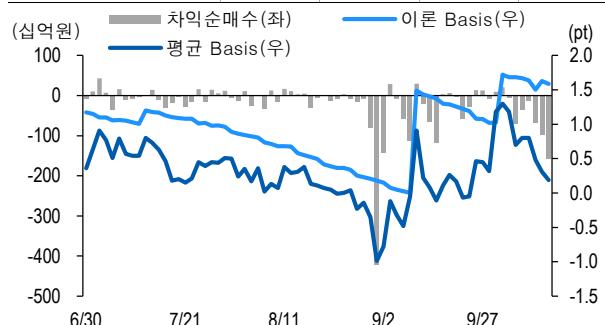
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	282.57	-1.57	-4.52	5,344.2	-
선물 12월물	282.80	-1.75	-5.05	24,713.5	333,176
선물 3월물	280.30	-1.92	-5.50	40.0	13,962
10월물(mini)	283.90	-1.18	-3.38	1,168.5	0
11월물(mini)	282.06	-2.02	-5.82	1,127.9	45,680



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.59	0.19	0.23	-0.49%
베이시스(mini)	0.00	0.02	1.33	0.01%
제1스프레드(SP)	-2.35	-2.23	-2.25	0.04%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	1.35	1.35	0.48%



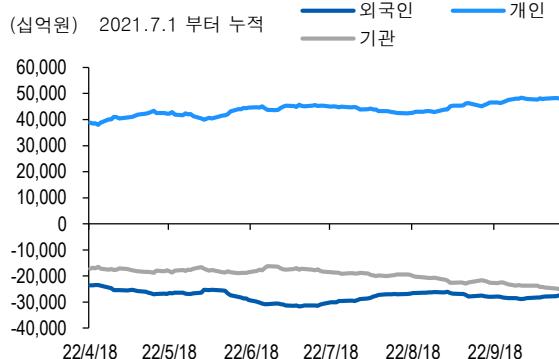
투자주체별 매매 동향

(십억원)

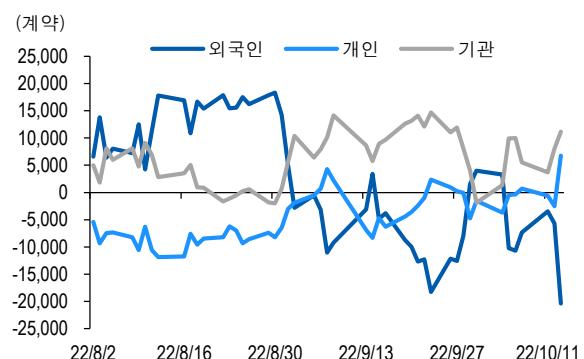
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	193.0	9.4	202.4	-3.1	60.1	-1,179.2	127.7	2.8	-11.4	-11.6
개인	80.8	34.6	115.4	0.0	1.2	607.3	56.3	1.6	4.3	-19.8
기관	-299.9	-49.4	-349.2	-154.3	-163.1	417.7	-190.7	-2.0	6.7	30.7
금융투자	-40.9	-84.6	-125.6	-111.3	-105.3	920.6	-182.6	1.4	6.4	50.2
투신	-65.7	10.3	-55.4	-0.5	-9.1	-462.3	-7.4	-2.7	0.1	10.1
은행+보험+기타금융	-5.9	20.0	14.2	0.0	0.3	-31.2	-0.7	-0.6	0.1	1.8
연기금+국가지자체	-146.4	-37.7	-184.1	0.0	-41.1	-9.4	0.0	-0.1	0.1	-31.3
기타법인	26.1	5.4	31.5	0.0	0.0	154.2	6.7	-2.4	0.3	0.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,234,539	284.2	785,275	15.7%	지수옵션 전체	4,155,341	681.8	1,767,111
Put	1,920,802	397.6	981,836	6.1%	PCR(금액기준)	1.40	VKOSPI	27.22% (+2.53%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	295.0(K+3)	0.01	-0.03	6,180	0	-54,046	32.8	
	292.5(K+2)	0.01	-0.12	100,606	0	-53,298	27.0	
	290.0(K+1)	0.01	-0.46	252,897	0	-44,392	21.0	
	287.5(K+0)	0.02	-1.35	715,799	0	-26,327	16.3	
	285.0(K-1)	0.03	-2.88	792,116	0	-20,595	9.8	
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	290.0(K+1)	6.07	2.85	12,970	0	-29,593	20.4	
	287.5(K+0)	3.60	1.98	134,709	0	-23,306	15.2	
	285.0(K-1)	1.12	0.44	581,365	0	-34,977	6.7	
	282.5(K-2)	0.08	-0.15	786,739	0	-47,660	2.1	
	280.0(K-3)	0.02	-0.06	130,245	0	-64,627	9.7	

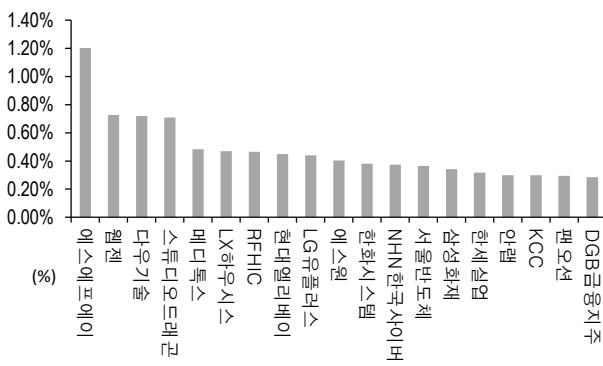
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,986,119	2,884.3	3,566,372	-1,046,560	15,896	-74,336	54,650	-11.6	-19.8	30.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
고려아연	607,000	-0.33	19.1	52.1	0	-2,916	-0.10%	324	-62	-275
삼성전기	115,000	-1.71	22.6	51.4	0	-22,758	0.04%	-1,551	1,234	291
한화솔루션	45,750	-5.38	38.8	48.9	0	-57,509	-0.09%	-431	979	-548
대한항공	20,850	-4.79	24.5	46.9	0	-78,507	0.00%	6,796	-13,132	6,358
호텔신라	73,000	-1.22	8.0	42.9	0	-13,178	-0.09%	304	759	-1,063
롯데케미칼	154,500	-4.92	14.0	41.3	0	-6,042	-0.01%	-3,169	748	2,421
파라다이스	14,400	-3.03	4.3	40.0	0	-25,389	0.08%	-253	875	-622
삼성전자	55,600	-0.36	297.3	39.7	0	-503,976	-0.10%	-14,048	-22,706	37,596
현대차	165,000	-1.49	41.2	36.3	0	-35,098	-0.05%	-2,735	770	2,016
하나투어	49,900	-3.29	2.9	35.1	0	-5,788	0.02%	-311	225	56

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터