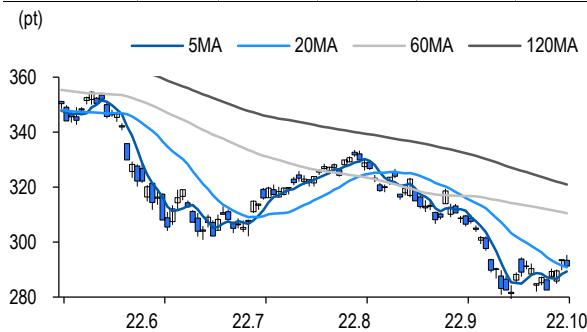


선물옵션시장 지표

2022.10.20

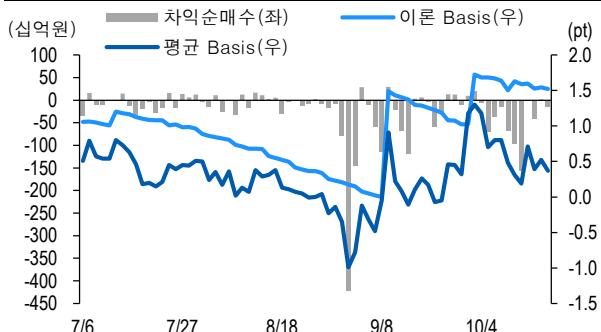
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	291.29	-0.78	-2.30	5,630.9	-
선물 12월물	291.30	-1.09	-3.20	24,959.6	336,361
선물 3월물	289.05	-1.08	-3.15	30.8	16,467
11월물(mini)	291.00	-1.03	-3.04	1,486.9	58,586
12월물(mini)	291.30	-1.09	-3.20	6.7	2,840



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.52	0.37	0.01	-0.39%
베이시스(mini)	0.67	0.00	-0.29	-0.23%
제1스프레드(SP)	-2.16	-2.19	-2.20	-0.01%
합성선물 베이시스(ATM)	0.67	-0.32	-0.32	-0.34%



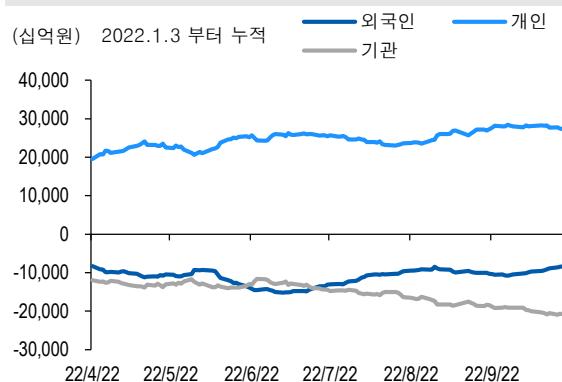
투자주체별 매매 동향

(십억원)

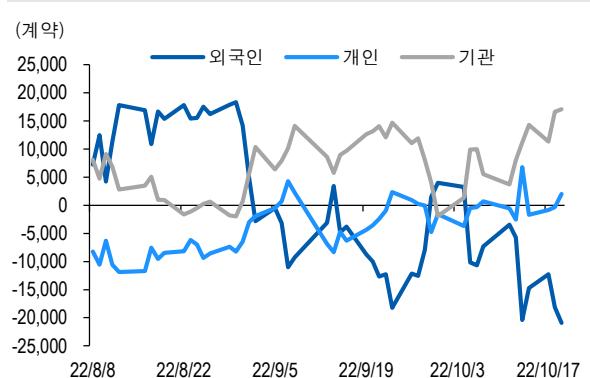
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	149.8	-37.9	111.9	-2.0	96.8	-142.8	-66.0	0.0	-0.2	8.1
개인	-90.7	13.5	-77.2	0.0	-3.2	122.9	47.5	1.0	-2.3	17.2
기관	-82.9	21.3	-61.7	-11.8	18.0	12.1	20.0	-0.5	2.2	-40.9
금융투자	-111.7	12.5	-99.2	-3.0	-1.1	296.0	20.1	-1.4	4.3	-16.9
투신	48.6	18.1	66.7	0.0	25.8	-275.7	0.0	-0.1	-0.1	-27.2
은행+보험+기타금융	21.4	0.8	22.2	0.0	9.6	-10.8	0.0	1.1	-2.0	0.2
연기금+국가지자체	-29.4	-20.6	-50.0	0.0	-6.4	2.6	0.0	0.0	0.0	3.1
기타법인	23.8	3.2	26.9	0.0	-2.4	7.9	-1.6	-0.5	0.3	15.6

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	753,903	245.6	959,217	19.2%	지수옵션 전체	1,543,624	497.8	2,279,992							
Put	789,721	252.2	1,320,775	23.8%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	23.21% (+0.35%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	300.0(K+3)	2.54	-1.15	40,548	22,753	567	19.2	Put	295.0(K+1)	8.38	1.54	5,015	5,432	1,204	23.1
	297.5(K+2)	3.36	-1.32	19,162	13,774	476	19.3		292.5(K+0)	7.05	1.32	8,598	6,215	2,031	23.2
	295.0(K+1)	4.35	-1.53	11,618	12,297	233	19.6		290.0(K-1)	5.87	1.13	13,740	10,897	1,926	23.4
	292.5(K+0)	5.52	-1.72	6,502	8,582	608	19.8		287.5(K-2)	4.84	0.92	14,944	7,060	446	23.6
	290.0(K-1)	6.82	-1.96	3,037	12,423	-82	19.9		285.0(K-3)	3.97	0.81	36,593	12,150	1,138	23.9

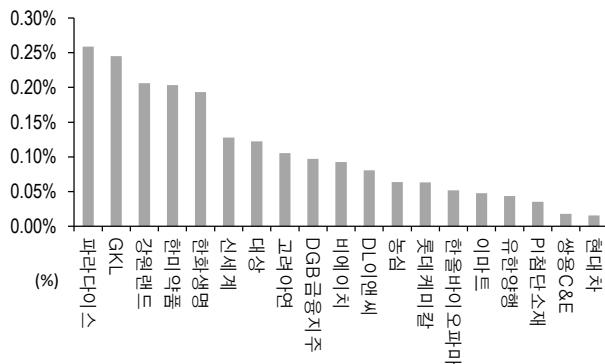
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,777,837	2,585.2	4,159,128	81,740	7,011	4,578	-21,159	8.1	17.2	-40.9
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	169,500	0.89	185.0	98.5	42,650	-5,377	0.02%	-1,724	7,871	-13,069
삼성전자	56,000	-1.23	615.5	86.9	1,111,807	18,929	-0.13%	7,070	-17,855	10,655
영원무역	45,250	-0.44	1.5	75.1	2,409	599	-0.30%	-465	101	344
삼성전기	117,500	-2.08	39.1	73.9	31,056	2,174	-0.03%	1,352	1,031	-2,383
코스맥스	46,700	0.97	1.2	68.1	2,134	180	-0.02%	153	17	-170
롯데케미칼	159,500	-4.49	17.8	67.1	8,633	146	0.06%	852	-461	-391
기아	69,000	0.15	87.5	64.5	53,581	-9,615	0.01%	6,357	21,149	-32,347
대한항공	23,150	1.98	29.4	62.4	99,111	-11,397	-0.06%	-1,012	350	1,162
SK 하이닉스	92,900	-2.93	209.3	62.2	174,977	5,220	-0.34%	2,658	-1,902	-737
LG 화학	592,000	-2.95	129.5	58.9	8,170	-171	-0.21%	-148	-225	237

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터