

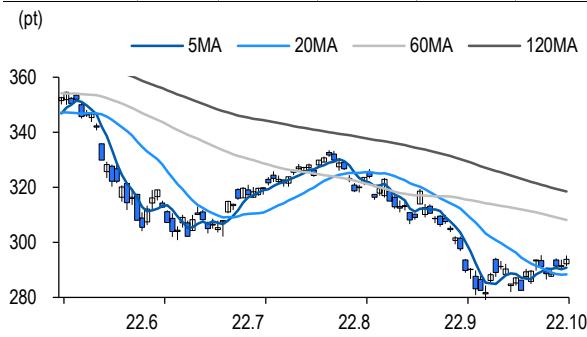


선물옵션시장 지표

2022.10.27

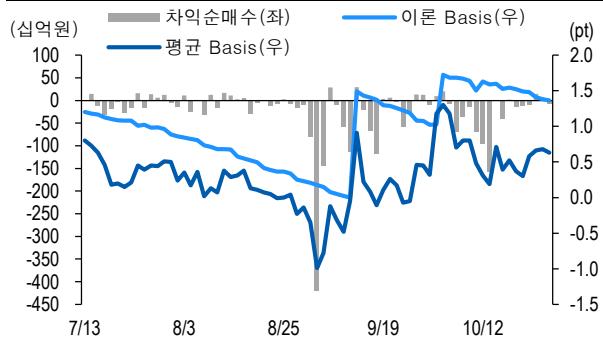
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	293.85	0.78	2.27	5,804.8	-
선물 12월물	294.70	0.77	2.25	20,837.3	341,277
선물 3월물	292.55	0.83	2.40	36.2	18,133
11월물(mini)	294.22	0.79	2.30	1,386.4	90,635
12월물(mini)	294.74	0.78	2.42	8.6	5,770



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.36	0.63	0.85	-0.25%
베이시스(mini)	0.48	0.08	0.37	-0.13%
제1스프레드(SP)	-1.99	-2.39	-2.40	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.48	0.33	0.33	-0.05%



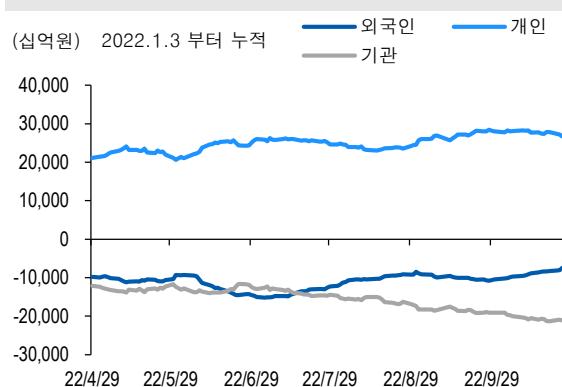
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	611.8	14.3	626.1	2.2	465.6	744.2	11.3	-0.6	-6.0	-20.7
개인	-497.1	37.3	-459.8	0.0	-0.4	-433.9	-50.3	-0.3	1.1	-8.4
기관	-119.4	-65.1	-184.5	-8.7	-23.0	-323.5	42.9	0.9	5.2	28.3
금융투자	-128.4	-68.9	-197.3	-7.2	0.8	-497.3	38.9	0.8	5.1	18.2
투신	32.0	9.3	41.3	0.0	2.2	189.0	4.0	0.1	0.1	7.7
은행+보험+기타금융	10.4	-27.2	-16.7	0.0	4.6	-15.0	0.0	0.0	0.0	2.2
연기금+국가지자체	-47.7	6.9	-40.8	-0.1	-29.5	-0.2	0.0	0.0	0.0	0.2
기타법인	4.7	13.6	18.2	0.0	-0.1	13.2	-3.9	0.0	-0.3	0.8

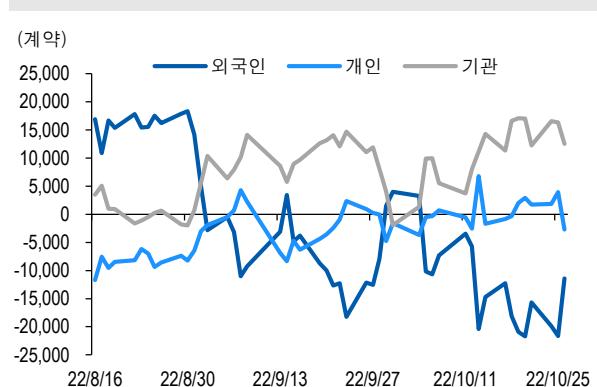
자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안티증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	802,005	260.9	1,079,320	20.1%	지수옵션 전체	1,707,134	487.4	2,658,650
Put	905,129	226.6	1,579,330	23.0%	PCR(금액기준)	0.87	VKOSPI	23.42%(-0.81%p)
(계약, 십억원)								
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	300.0(K+3)	2.64	0.34	61,825	26,720	252	20.0	Put
	297.5(K+2)	3.63	0.48	26,948	18,543	386	20.4	295.0(K+1)
	295.0(K+1)	4.80	0.68	22,068	17,729	889	20.8	292.5(K+0)
	292.5(K+0)	6.15	0.78	13,919	14,703	816	21.1	290.0(K-1)
	290.0(K-1)	7.71	0.96	4,741	13,708	-236	21.6	287.5(K-2)
								285.0(K-3)

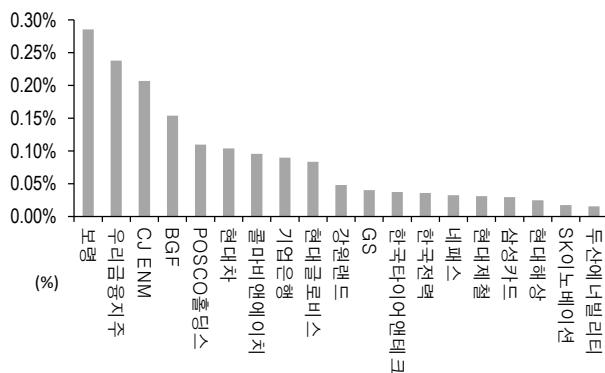
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)
주식선물 전체	3,633,269	2,210.7	4,769,889	220,250	-14,473	-48,192	59,583	-20.7	-8.4	28.3
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
LG 디스플레이	12,950	-1.52	23.2	115.1	263,919	52,741	-1.90%	18,935	-16,141	-1,114
SK 하이닉스	93,800	0.21	255.3	82.0	176,707	9,960	-0.18%	681	3,738	-3,087
LX 하우시스	30,700	0.00	0.3	67.2	1,257	106	-1.55%	-51	66	-15
NH 투자증권	8,740	-0.11	3.1	66.8	39,705	12,526	-0.67%	-1,943	-56	1,999
일진머티리얼즈	56,300	-1.23	10.3	62.5	41,511	1,306	-0.07%	571	622	-1,211
한국금융지주	46,750	-0.74	6.0	59.7	22,806	119	-0.29%	-158	334	-263
한화솔루션	48,250	2.77	50.7	54.7	72,138	490	-0.13%	613	-4,899	4,586
SK 이노베이션	154,500	0.00	23.3	53.3	13,008	186	0.02%	431	-570	139
현대차	161,000	-1.23	84.5	51.4	43,006	2,165	0.10%	-166	2,059	-1,893
코스맥스	46,150	-2.33	0.9	50.5	1,824	30	-0.39%	44	-17	-27

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터