

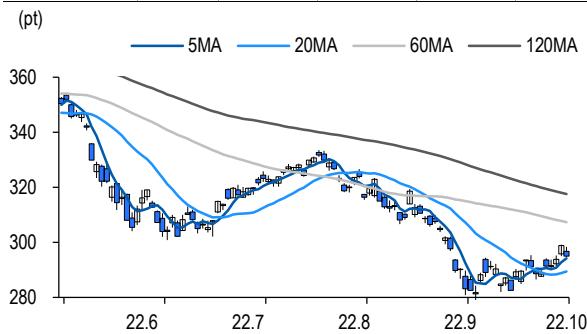


선물옵션시장 지표

2022.10.31

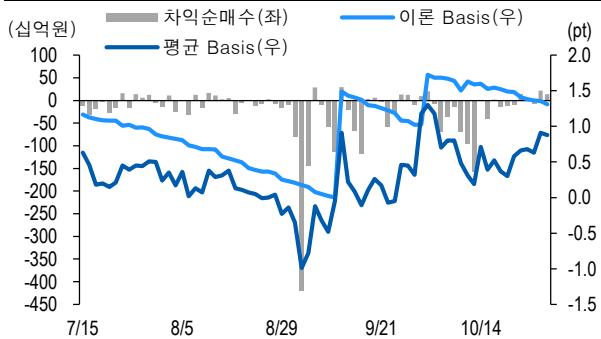
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	295.06	-1.26	-3.76	6,379.6	-
선물 12월물	295.80	-1.28	-3.85	21,134.2	339,232
선물 3월물	293.45	-1.31	-3.90	33.6	19,107
11월물(mini)	295.24	-1.31	-3.92	1,331.0	81,013
12월물(mini)	295.62	-1.35	-4.00	7.2	6,715



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.31	0.88	0.74	-0.15%
베이시스(mini)	0.42	0.32	0.18	-0.03%
제1스프레드(SP)	-1.97	-2.31	-2.30	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	0.42	0.21	0.21	-0.07%



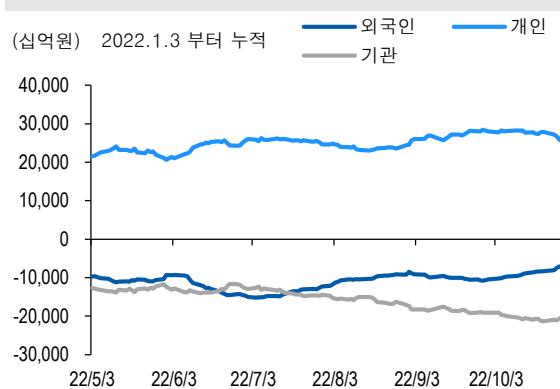
투자주체별 매매 동향

(십억원)

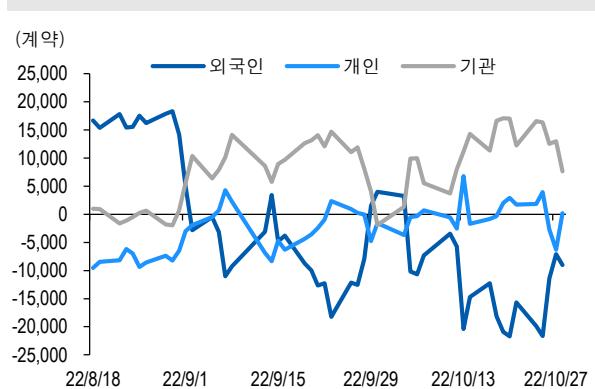
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-192.1	7.7	-184.5	12.0	-86.9	-141.3	-1.8	-5.7	3.7	-7.1
개인	-67.9	16.8	-51.1	0.0	-0.5	419.1	62.8	2.0	-1.7	74.5
기관	252.0	-20.0	231.9	2.1	1.1	-331.0	-64.9	3.1	-1.6	-66.6
금융투자	426.1	63.0	489.0	2.0	33.6	267.6	-59.4	3.1	-1.7	18.3
투신	-52.8	-16.5	-69.3	0.0	-11.4	-608.8	-5.5	0.0	0.1	-87.2
은행+보험+기타금융	14.3	-22.4	-8.1	0.0	26.3	12.8	0.0	0.0	0.0	0.4
연기금+국가지자체	-58.5	-8.0	-66.5	0.1	-21.9	-2.7	0.0	0.0	0.0	1.8
기타법인	8.1	-4.4	3.6	0.0	-0.3	53.3	3.9	0.5	-0.4	-0.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)									
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정	
Call	848,820	241.7	1,098,597	18.3%	지수옵션 전체		1,712,334	475.0	2,751,594
Put	863,514	233.2	1,652,997	21.4%	PCR(금액기준)		0.96	VKOSPI	22.71% (+0.59%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	307.5(K+3)	0.70	-0.76	88,618	26,388	3,092	18.1	302.5(K+1)	9.01
	305.0(K+2)	1.14	-1.04	97,442	31,183	3,537	18.5	300.0(K+0)	7.30
	302.5(K+1)	1.75	-1.38	58,312	27,319	1,475	18.8	297.5(K-1)	5.82
	300.0(K+0)	2.57	-1.74	59,582	25,802	-13	19.2	295.0(K-2)	4.61
	297.5(K-1)	3.64	-2.04	18,727	16,417	284	19.7	292.5(K-3)	3.57
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	302.5(K+1)	9.01	2.45	581	808	70	20.2	300.0(K+0)	7.30
	300.0(K+0)	7.30	2.08	7,019	10,530	1,022	20.3	297.5(K-1)	5.82
	297.5(K-1)	5.82	1.74	14,196	5,321	2,323	20.6	295.0(K-2)	4.61
	295.0(K-2)	4.61	1.50	25,285	12,118	951	21.1	292.5(K-3)	3.57
	292.5(K-3)	3.57	1.19	47,222	14,323	978	21.5		

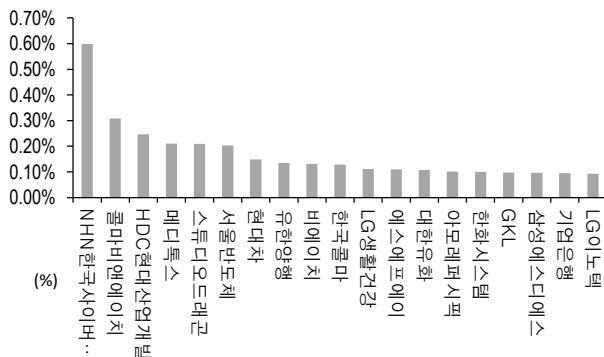
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)											
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	
주식선물 전체	4,068,679	2,689.4	4,775,439	-1,121	-19,667	82,690	-60,190	-7.1	74.5	-66.6	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	
코스맥스	45,950	-1.29	1.5	86.1	2,206	325	-0.24%	209	-18	-191	-191
삼성전기	117,500	-4.08	59.8	68.0	36,730	4,531	-0.38%	1,432	2,701	-4,136	7,111
삼성전자	57,500	-3.36	811.2	67.8	1,214,525	-49,290	-0.16%	34,098	24,653	-58,345	32,071
LG 이노텍	288,000	0.17	66.2	64.9	12,273	-366	0.09%	87	4,730	-4,819	-2,650
넷마블	43,850	-1.90	4.4	57.9	11,349	-509	0.01%	561	-34	-527	-202
호텔신라	71,400	0.28	4.8	57.5	19,111	-151	-0.01%	1,508	-1,087	-421	-776
현대차	164,500	0.92	68.9	55.9	47,293	2,827	0.15%	5,867	-3,217	-2,829	-3,004
엔씨소프트	384,000	1.59	14.1	55.8	4,843	-18	-0.22%	14	-69	48	-131
대한항공	23,150	0.65	17.4	55.7	90,631	-1,345	-0.15%	27	-1,749	1,922	-856
현대건설	35,200	-0.71	12.4	55.0	20,627	-6,438	-0.23%	-5,758	-489	6,247	9,101

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터