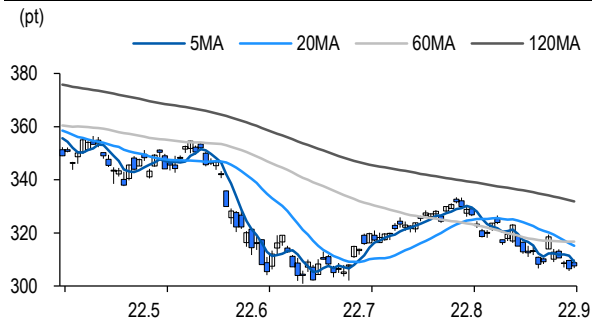


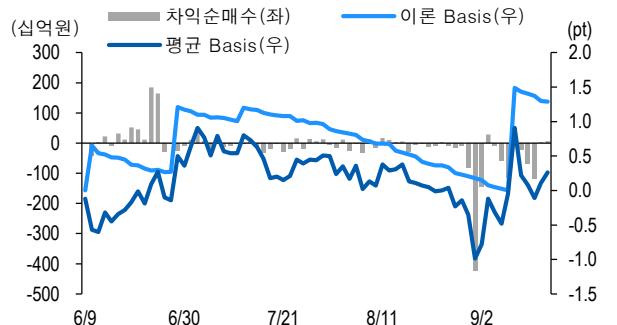
선물옵션시장 지표

2022.9.21

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	307.54	0.34	1.05	4,935.4	-
선물 12월물	307.55	0.21	0.65	18,007.6	300,249
선물 3월물	305.70	0.31	0.95	18.3	6,579
10월물(mini)	306.82	0.22	0.66	1,329.6	82,427
11월물(mini)	307.30	0.24	0.74	4.0	6,836

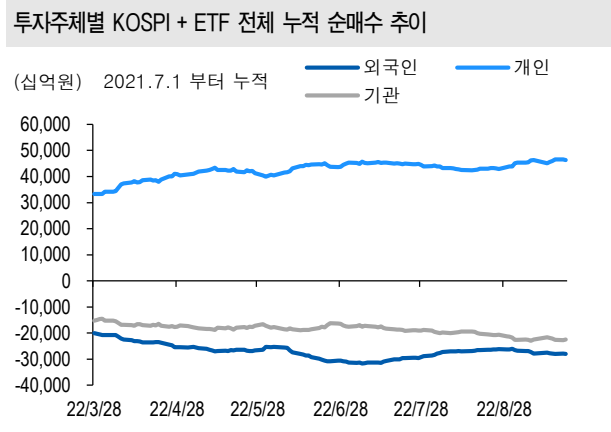


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.29	0.26	0.01	-0.33%
베이스(mini)	0.58	-0.47	-0.72	-0.34%
제1스프레드(SP)	-2.59	-1.90	-1.90	0.22%
합성선물 베이스(ATM)	0.58	-0.71	-0.71	-0.42%

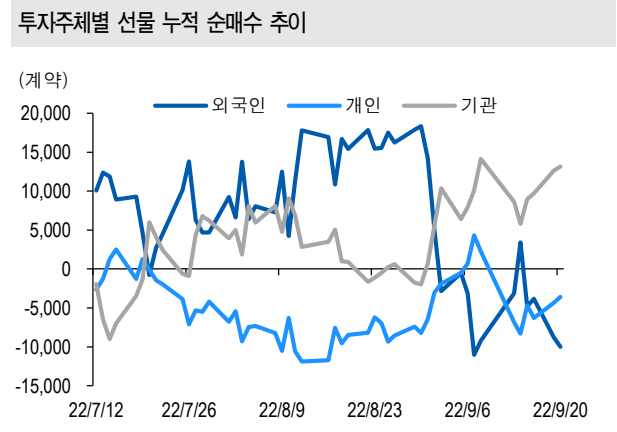


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-77.0	13.5	-63.5	0.4	64.3	-42.9	-52.5	0.2	-1.9	30.1
개인	-224.8	-25.5	-250.3	0.0	0.0	47.8	12.7	1.0	-0.5	-22.3
기관	283.2	11.0	294.2	5.9	23.8	-0.2	39.8	-1.1	2.0	-9.0
금융투자	260.4	8.3	268.7	4.3	-0.4	-195.3	39.7	-0.9	2.6	1.3
투신	14.0	-16.9	-2.8	0.0	6.5	202.4	0.0	-0.2	0.0	-7.6
은행+보험+기타금융	-5.0	14.7	9.7	0.0	-2.9	15.3	0.0	0.0	-0.6	0.3
연기금+국가자재	32.1	8.0	40.2	1.6	21.7	-22.6	0.0	0.0	0.0	-3.0
기타법인	18.6	1.1	19.7	0.0	-0.7	-4.7	0.0	-0.1	0.5	1.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



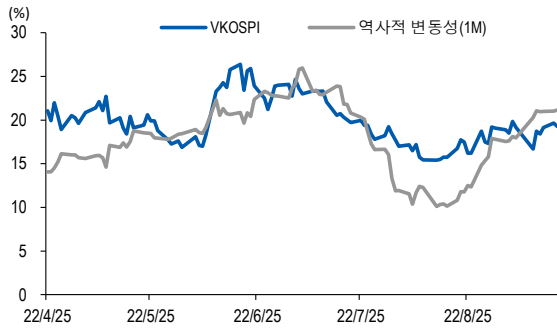
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	514,784	156.1	891,656	15.7%	지수옵션 전체	1,100,908	351.7	2,302,968
Put	586,124	195.7	1,411,312	19.5%	PCR(금액기준)	1.25	VKOSPI	19.28%(-0.36%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	315.0(K+3)	2.10	0.02	55,641	20,312	3,284	15.7	Put	310.0(K+1)	7.17	-0.50	5,356	20,956	-66	18.4
	312.5(K+2)	2.94	0.03	24,334	11,721	1,543	16.0		307.5(K+0)	5.86	-0.51	7,866	17,156	425	18.6
	310.0(K+1)	3.99	0.14	13,255	9,334	955	16.4		305.0(K-1)	4.79	-0.43	13,132	21,577	277	19.0
	307.5(K+0)	5.19	0.16	6,819	5,356	699	16.6		302.5(K-2)	3.86	-0.39	15,518	16,570	770	19.3
	305.0(K-1)	6.59	0.20	2,154	3,223	193	16.9		300.0(K-3)	3.09	-0.36	36,359	21,843	39	19.7

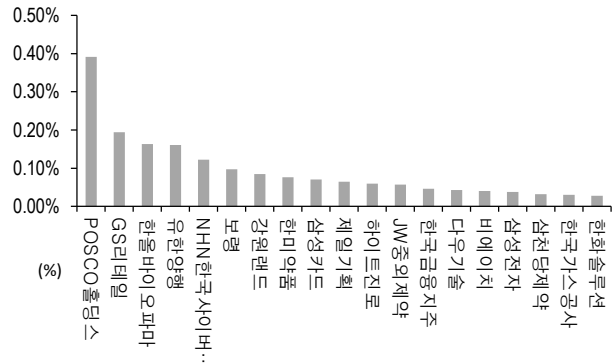
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 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	2,819,018	1,903.6	3,971,164	81,721	84,672	-29,717	-62,617	30.1	-22.3	-9.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	198,500	-1.49	130.2	94.3	48,905	2,446	0.01%	-2,052	1,647	578	678	-100
삼성전자	55,600	-0.71	559.6	71.8	1,121,057	21,492	0.04%	12,493	1,054	-13,600	-6,998	-3,691
LG 화학	629,000	-0.94	59.6	62.7	8,635	218	-0.11%	192	-81	-115	187	-305
한화솔루션	50,800	0.59	56.0	62.6	115,688	333	0.03%	-1,078	-897	2,003	1,079	924
한화에어로	74,600	1.22	44.9	54.4	23,749	-3,769	-0.32%	220	-1,032	832	6,083	365
일진머티리얼즈	63,200	0.00	10.3	54.2	43,784	571	0.02%	1,124	119	-1,313	-419	-894
SK 이노베이션	179,500	1.41	25.7	52.8	11,302	-42	-0.06%	-51	131	-80	-375	372
현대건설	44,450	2.30	9.4	51.8	18,774	563	-0.07%	773	-357	-416	-105	-294
삼성전기	127,500	-1.16	35.9	49.8	35,313	818	-0.09%	-70	752	-701	-118	-583
현대제철	34,000	1.49	8.5	49.7	17,448	1,725	-0.07%	4,132	-1,105	-3,076	-3,187	111

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터