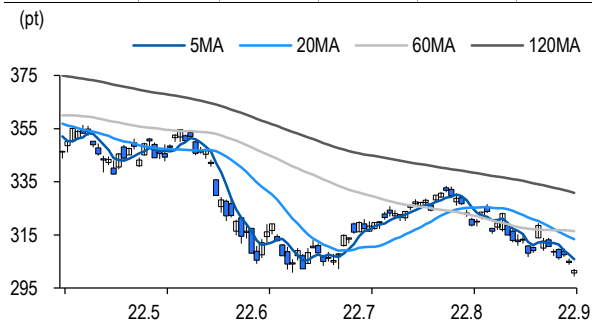


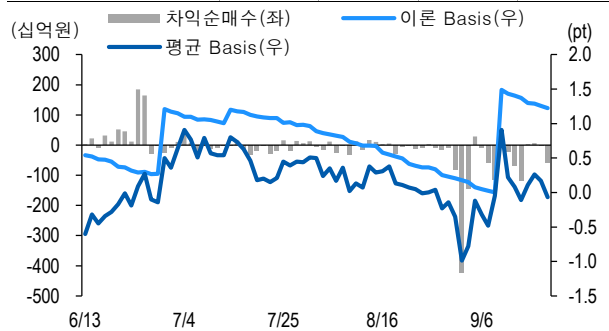
선물옵션시장 지표

2022.9.23

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	301.65	-0.99	-3.02	5,097.2	-
선물 12월물	301.05	-1.10	-3.35	21,117.0	314,554
선물 3월물	299.50	-1.01	-3.05	24.3	8,312
10월물(mini)	300.36	-1.11	-3.36	1,702.5	84,093
11월물(mini)	300.82	-1.05	-3.18	20.3	6,843



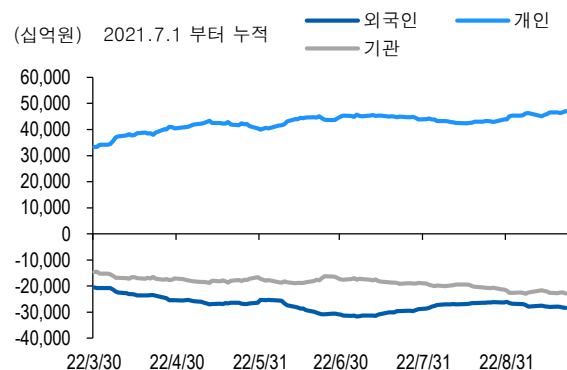
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.22	-0.07	-0.60	-0.43%
베이스(mini)	0.53	-0.81	-1.29	-0.44%
제1스프레드(SP)	-2.61	-1.86	-1.85	0.25%
합성선물 베이스(ATM)	0.53	-1.22	-1.22	-0.58%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-60.8	-15.3	-76.1	-3.0	-54.0	74.4	-45.3	2.1	-0.2	-7.7
개인	314.1	79.7	393.7	0.0	-1.3	114.7	-7.9	-3.5	4.2	5.7
기관	-282.9	-69.0	-352.0	-55.9	-1.2	-199.5	48.7	1.7	-5.4	3.1
금융투자	-241.7	52.4	-189.3	-42.3	9.7	-227.2	41.8	2.8	-2.6	6.2
투신	-8.2	-118.3	-126.4	0.0	-4.9	50.4	6.9	-0.3	0.0	2.0
은행+보험+기타금융	6.7	11.8	18.5	0.0	2.1	-18.5	0.0	-0.7	-2.8	0.0
연기금+국가지자체	-12.7	-22.3	-35.0	0.0	-0.3	-4.2	0.0	0.0	0.0	-5.1
기타법인	29.7	4.7	34.3	0.0	0.4	10.4	4.5	-0.3	1.3	-1.1

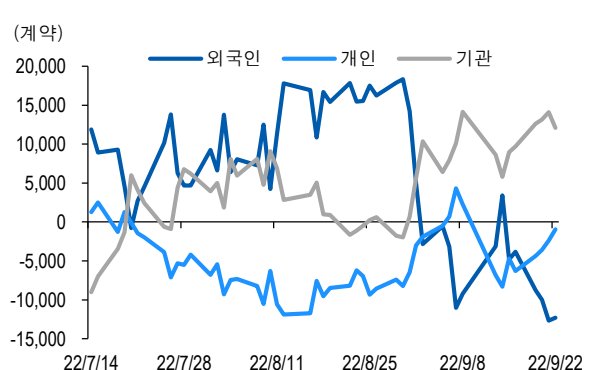
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



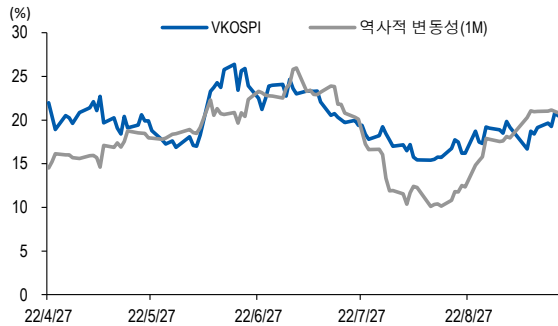
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	792,464	189.5	989,470	15.7%	지수옵션 전체	1,648,613	498.1	2,493,926
Put	856,149	308.6	1,504,456	20.6%	PCR(금액기준)	1.63	VKOSPI	20.47%(-0.33%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	312.5(K+3)	1.11	-1.09	89,848	15,814	2,671	15.6	Put	307.5(K+1)	9.46	1.67	2,926	16,993	-424	20.1
	310.0(K+2)	1.67	-1.35	75,072	16,806	4,441	15.9		305.0(K+0)	7.87	1.45	6,512	21,277	-1,252	20.1
	307.5(K+1)	2.39	-1.58	56,925	13,529	6,559	16.1		302.5(K-1)	6.48	1.19	6,385	17,403	-251	20.2
	305.0(K+0)	3.30	-1.85	26,647	8,034	2,250	16.4		300.0(K-2)	5.28	0.93	13,957	20,559	-305	20.4
	302.5(K-1)	4.38	-2.15	12,941	4,397	2,560	16.5		297.5(K-3)	4.27	0.68	16,236	20,067	-228	20.7

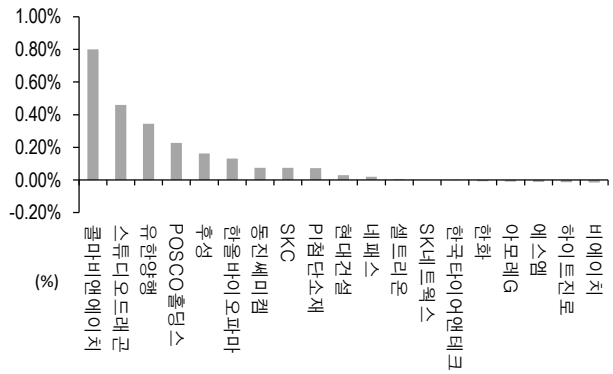
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,812,526	1,743.5	4,093,939	53,315	-47,651	12,262	35,924	-7.7	5.7	3.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	193,500	-1.78	95.5	92.7	50,713	2,794	-0.02%	-2,897	1,404	1,523	788	735
일진머티리얼즈	62,200	-0.16	11.5	66.0	44,060	-336	-0.02%	860	-936	76	-511	587
한화솔루션	51,000	3.34	63.0	59.7	116,510	-3,535	-0.06%	53	-1,476	1,322	251	-143
삼성전자	54,200	-1.28	393.9	56.8	1,162,877	19,619	-0.15%	-23,764	-2,894	27,118	29,446	-2,300
LG 화학	627,000	0.16	58.3	56.2	8,779	55	-0.06%	374	56	-410	-264	-196
SK 하이닉스	85,900	-2.28	99.9	53.0	175,792	1,457	-0.25%	-6,096	8,762	-2,643	-4,122	-880
현대건설	42,950	-2.50	14.9	52.6	20,758	2,120	0.03%	3,451	392	-3,864	13	-3,870
LG 이노텍	355,000	3.20	53.8	52.0	7,604	-308	-0.13%	1,281	-1,391	64	94	210
메리츠증권	4,290	-6.33	5.2	50.1	54,649	8,386	-0.42%	-6,095	-12,196	18,291	19,259	0
한국조선해양	85,400	0.95	9.1	49.8	5,796	2	-0.05%	772	-419	-353	-156	-197

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터