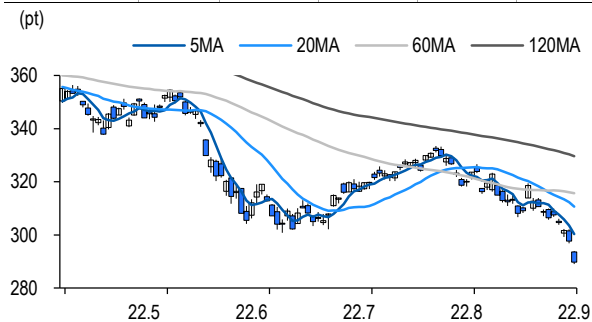


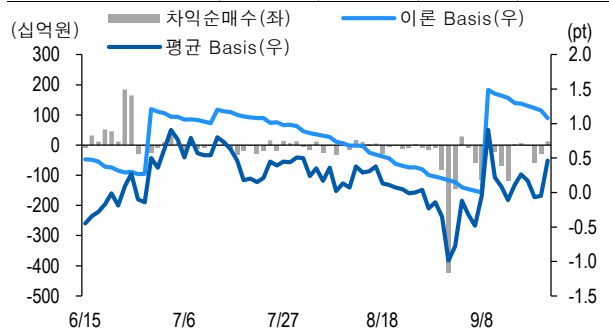
선물옵션시장 지표

2022.9.27

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	289.77	-2.68	-7.97	6,848.9	-
선물 12월물	290.30	-2.53	-7.55	27,400.9	333,251
선물 3월물	288.30	-2.50	-7.40	39.6	8,955
10월물(mini)	289.28	-2.63	-7.82	2,202.1	102,151
11월물(mini)	289.76	-2.63	-7.82	14.6	9,037



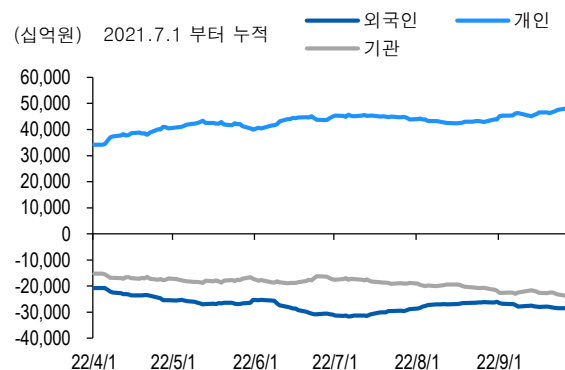
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.08	0.46	0.53	-0.21%
베이스(mini)	0.42	-0.49	-0.49	-0.31%
제1스프레드(SP)	-2.66	-1.93	-1.95	0.25%
합성선물 베이스(ATM)	0.42	-0.26	-0.26	-0.23%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-5.8	0.7	-5.1	12.7	-85.4	829.9	-382.5	-2.9	-33.2	79.1
개인	-244.7	128.2	-116.5	0.0	-4.6	-191.6	89.7	-6.9	38.4	-21.3
기관	279.0	-121.4	157.6	0.4	-72.9	-556.1	291.8	11.4	-16.4	-55.7
금융투자	604.2	-134.7	469.5	0.3	-5.9	-389.0	282.9	12.7	-16.6	-33.5
투신	-88.5	-55.6	-144.1	0.0	-10.5	-178.2	7.0	-0.4	0.3	-12.3
은행+보험+기타금융	-15.0	-27.1	-42.1	0.0	-0.1	-24.2	1.9	-0.8	-0.2	-6.3
연기금+국가지자체	-98.9	111.9	13.0	0.2	-60.0	35.2	0.0	0.0	0.0	-3.6
기타법인	-28.5	-7.5	-36.0	0.0	-0.5	-82.1	0.9	-1.6	11.2	-2.0

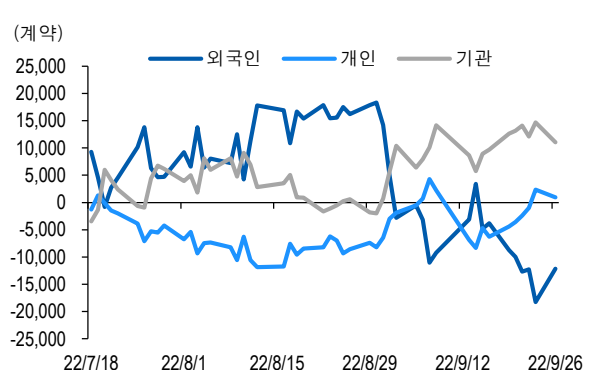
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,176,241	260.0	1,143,411	19.5%	지수옵션 전체	2,722,885	825.5	2,684,367
Put	1,546,644	565.5	1,540,956	22.3%	PCR(금액기준)	2.18	VKOSPI	24.02%(+3.69%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	305.0(K+3)	0.66	-1.26	163,113	28,787	13,341	19.1	Put	300.0(K+1)	12.25	5.59	4,677	19,237	-1,100	21.1
	302.5(K+2)	1.05	-1.74	125,759	19,875	10,968	19.6		297.5(K+0)	10.35	4.97	5,838	18,633	-1,116	21.0
	300.0(K+1)	1.55	-2.22	98,100	19,185	11,935	19.9		295.0(K-1)	8.74	4.49	12,708	26,722	-1,048	21.5
	297.5(K+0)	2.36	-2.67	60,685	11,834	8,415	21.0		292.5(K-2)	7.31	3.98	15,803	23,511	-1,001	22.1
	295.0(K-1)	3.12	-3.26	33,831	8,617	6,917	21.0		290.0(K-3)	6.03	3.42	25,806	34,531	-1,822	22.5

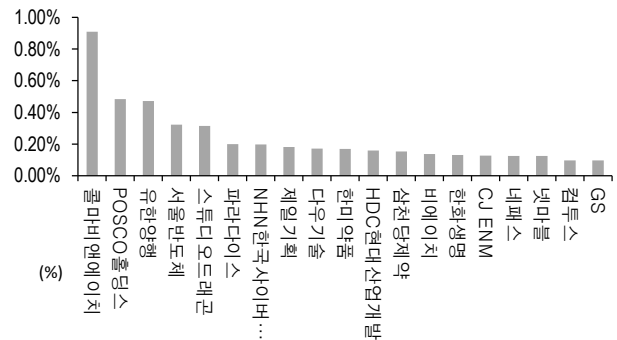
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,070,050	2,417.8	4,290,440	151,167	152,284	-54,625	-93,497	79.1	-21.3	-55.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	183,000	-4.69	226.5	89.0	48,444	-1,570	0.00%	4,179	-2,692	-1,267	374	329
일진머티리얼즈	55,600	-5.60	17.5	64.6	41,691	-653	-0.21%	6,612	-7,178	566	-60	542
코스맥스	54,700	-3.70	3.7	63.9	1,959	-1	-0.07%	193	48	-241	-227	-14
한화솔루션	46,500	-6.53	129.9	62.0	114,618	-1,602	0.01%	19,809	-4,079	-15,653	-19,440	-142
LG 화학	572,000	-5.14	81.6	62.0	8,962	366	0.00%	1,019	-234	-801	-998	198
삼성전기	121,000	0.00	60.4	61.9	32,968	-2,475	0.07%	2,203	-861	-1,342	-1,221	-89
SK 이노베이션	157,500	-4.26	42.0	60.2	12,733	-2,703	0.10%	3,041	337	-3,379	-4,161	-1,722
현대건설	39,000	-6.81	21.0	60.1	22,421	-880	-0.10%	4,467	-1,372	-2,929	365	4,834
SK 하이닉스	82,100	-1.91	139.5	59.9	198,020	9,116	-0.22%	1,779	3,483	-4,813	-7,452	790
삼성전자	53,300	-1.66	451.8	59.2	1,142,702	-7,339	-0.16%	4,149	374	-4,142	16,414	-5,380

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터