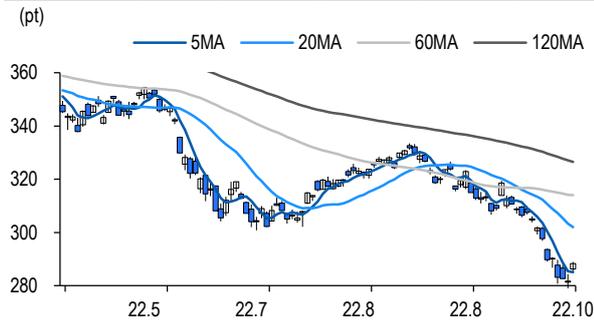


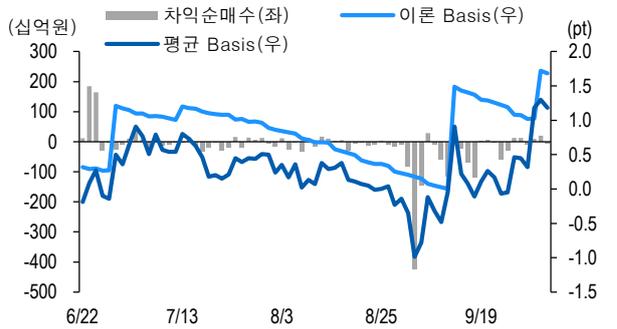
선물옵션시장 지표

2022.10.5

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	288.27	2.46	6.91	5,966.2	-
선물 12월물	290.00	2.67	7.55	23,177.3	346,091
선물 3월물	287.85	2.73	7.65	18.1	11,003
10월물(mini)	288.92	2.72	7.64	1,381.5	127,551
11월물(mini)	289.28	2.69	7.58	10.6	9,586

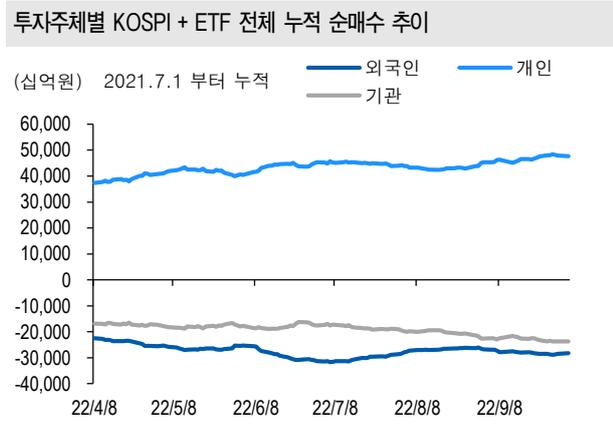


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	1.68	1.18	1.73	-0.17%
베이스스(mini)	0.23	0.09	0.65	-0.05%
제1스프레드(SP)	-2.54	-2.10	-2.10	0.15%
합성선물 베이스스(ATM)	0.23	0.61	0.61	0.13%

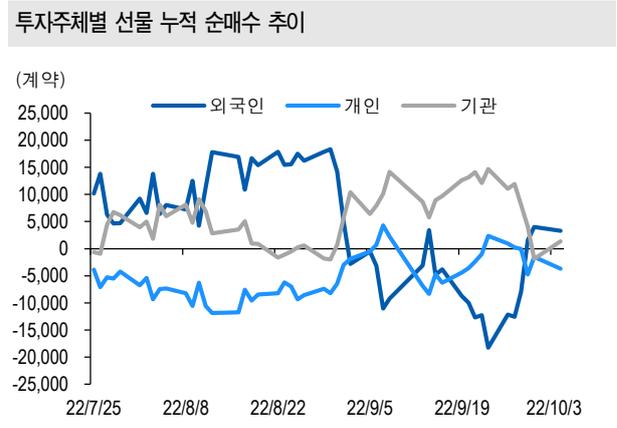


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	218.2	7.5	225.7	2.3	218.9	-129.5	76.1	6.2	0.5	-29.3
개인	-204.5	-35.2	-239.7	0.0	0.7	-121.1	-34.5	-0.5	-3.7	-12.5
기관	-16.8	33.0	16.2	-8.7	-52.5	272.9	-37.2	-3.6	2.6	41.4
금융투자	-56.9	53.3	-3.6	-7.2	-10.7	-102.6	-38.4	-2.6	2.7	25.6
투신	-8.2	5.2	-3.0	0.0	-5.7	474.8	1.2	0.0	-0.1	17.2
은행+보험+기타금융	-6.8	7.2	0.3	0.0	-1.6	-64.8	0.0	-1.0	0.0	0.3
연기금+국가자차체	-17.0	-24.9	-41.9	-0.1	-31.6	-34.5	0.0	0.0	0.0	-1.7
기타법인	3.0	-5.3	-2.2	0.0	0.3	-22.3	-4.4	-2.0	0.6	0.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,137,928	320.0	1,513,784	22.2%	지수옵션 전체	2,408,627	583.1	3,326,667
Put	1,270,699	263.1	1,812,883	23.9%	PCR(금액기준)	0.82	VKOSPI	24.99%(-2.20%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	290.0(K+3)	3.54	1.89	59,006	20,167	-2,032	22.2	Put	285.0(K+1)	2.65	-4.55	39,447	24,498	-2,695	22.1
	287.5(K+2)	4.84	2.43	28,365	12,078	622	22.7		282.5(K+0)	1.90	-3.84	53,200	24,361	-439	22.6
	285.0(K+1)	6.49	3.09	14,914	11,552	-324	23.8		280.0(K-1)	1.39	-3.29	77,231	30,795	-211	23.5
	282.5(K+0)	8.28	3.72	8,364	5,872	-120	24.8		277.5(K-2)	1.00	-2.64	65,285	22,006	-1,184	24.3
	280.0(K-1)	10.40	4.46	2,949	3,507	18	26.9		275.0(K-3)	0.70	-2.20	99,765	27,217	-1,207	24.9

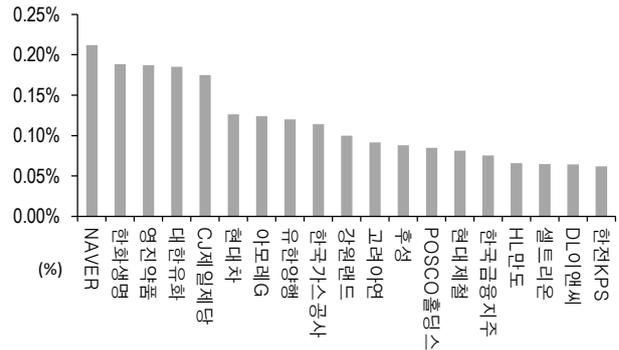
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	3,375,651	2,194.8	4,330,209	-1,564	-7,087	-28,330	33,985	-29.3	-12.5	41.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
엔씨소프트	355,500	3.04	28.6	84.8	6,827	24	-0.08%	-628	-1,315	1,943	498	15
BGF	3,350	2.13	0.2	67.2	4,627	-307	-0.18%	982	3	-985	-985	0
현대차	180,500	1.69	99.4	66.8	48,607	224	0.13%	2,125	-983	-1,141	-1,039	-394
삼성전자	55,100	3.96	621.4	59.0	1,083,490	-41,284	-0.08%	-32,624	-19,397	51,733	56,860	495
현대건설	38,800	3.33	9.2	58.6	21,003	785	0.04%	-552	736	-200	-300	100
일진머티리얼즈	53,500	5.31	11.4	57.3	38,840	1,192	-0.06%	4,208	-899	-3,343	-2,368	-582
호텔신라	74,400	3.19	11.1	57.2	15,007	-1,475	-0.15%	-2,148	-170	2,332	2,321	11
LG 이노텍	286,000	4.38	51.1	56.3	11,461	585	0.00%	922	-187	-358	-511	153
LG 화학	555,000	3.16	68.6	54.4	8,069	-154	0.02%	-23	-21	35	92	-73
SK 하이닉스	86,100	3.11	193.9	54.4	196,466	122	-0.11%	-12,364	4,645	7,326	11,613	-85

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터