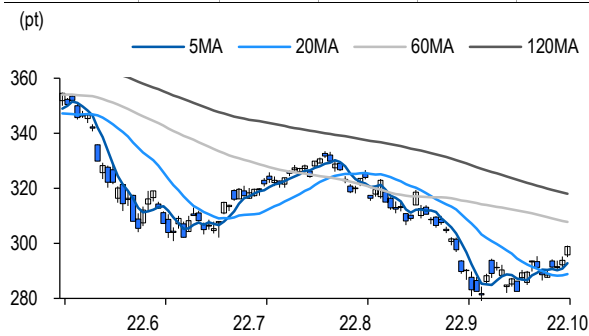


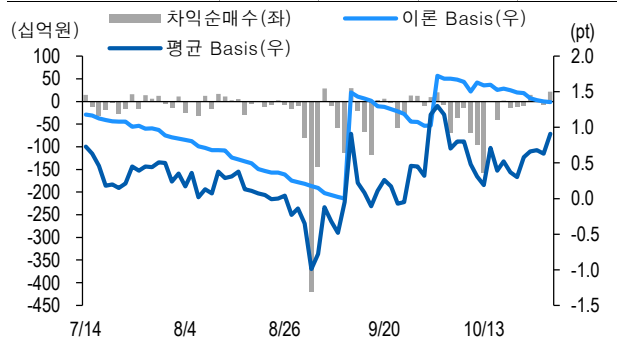
선물옵션시장 지표

2022.10.28

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	298.82	1.69	4.97	6,747.7	-
선물 12월물	299.65	1.68	4.95	23,346.2	335,913
선물 3월물	297.35	1.64	4.80	34.7	19,052
11월물(mini)	299.16	1.68	4.94	1,688.8	86,500
12월물(mini)	299.62	1.67	4.88	16.0	6,351



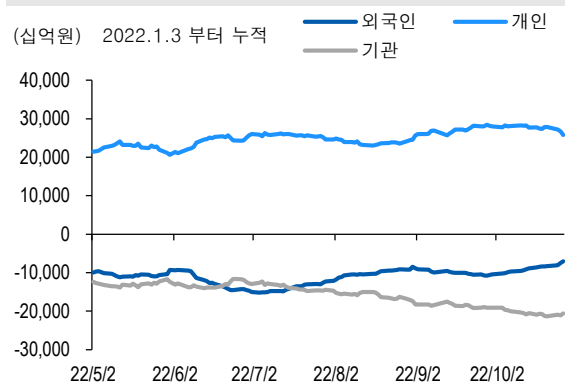
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.35	0.91	0.83	-0.15%
베이스스(mini)	0.45	0.33	0.34	-0.04%
제1스프레드(SP)	-1.94	-2.37	-2.35	-0.14%
합성선물 베이스스(ATM)	0.45	0.30	0.30	-0.05%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	379.2	25.9	405.1	19.2	326.9	192.2	125.2	-3.6	3.4	33.1
개인	-904.1	-31.9	-936.1	0.0	1.2	-234.6	-32.5	7.2	-10.1	16.9
기관	514.7	2.0	516.7	2.3	9.6	130.1	-93.6	-3.2	7.2	-49.1
금융투자	550.1	82.3	632.4	3.2	1.4	-112.8	-93.6	-3.4	6.2	-37.0
투신	18.7	33.4	52.1	0.0	16.0	182.7	0.0	0.4	0.5	-0.3
은행+보험+기타금융	14.8	-125.5	-110.7	0.0	7.4	38.9	0.0	-0.1	0.5	-10.1
연기금+국가지자체	-52.4	-1.1	-53.4	-0.2	-8.3	21.3	0.0	0.0	0.0	-1.7
기타법인	10.3	4.0	14.3	0.0	0.2	-87.7	0.9	-0.5	-0.5	-0.9

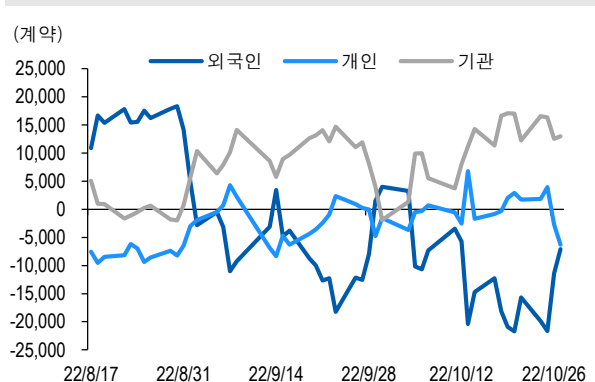
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



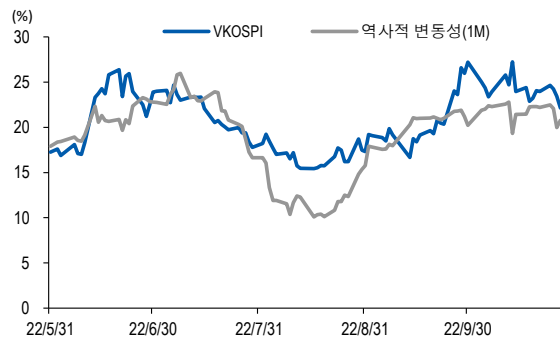
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	942,624	344.3	1,083,769	18.8%	지수옵션 전체	1,911,311	582.0	2,678,654
Put	968,687	237.8	1,594,885	21.7%	PCR(금액기준)	0.69	VKOSPI	22.12%(-1.30%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	302.5(K+3)	3.13	1.28	74,606	25,844	1,100	18.7	Put	297.5(K+1)	4.08	-2.92	9,027	2,998	1,322	20.5
	300.0(K+2)	4.31	1.67	49,011	25,815	-905	19.2		295.0(K+0)	3.11	-2.55	33,514	11,167	2,885	20.7
	297.5(K+1)	5.68	2.05	23,892	16,133	-2,410	19.6		292.5(K-1)	2.38	-2.09	33,011	13,345	1,300	21.2
	295.0(K+0)	7.23	2.43	15,323	16,818	-911	19.9		290.0(K-2)	1.78	-1.80	70,611	18,644	-1,451	21.6
	292.5(K-1)	8.95	2.80	2,780	14,544	-159	20.1		287.5(K-3)	1.32	-1.45	62,748	15,638	4,950	22.1

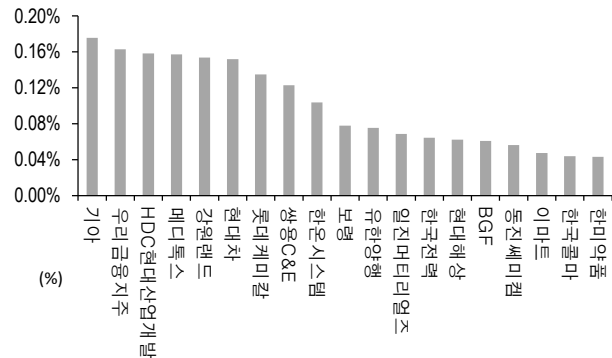
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,429,245	2,897.4	4,776,560	6,671	102,745	41,077	-143,905	33.1	16.9	-49.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
코스맥스	46,550	0.87	1.6	95.7	1,881	57	-0.29%	139	60	-199	-199	0
현대차	163,000	1.24	103.5	73.1	44,466	1,460	0.15%	444	1,689	-2,136	-4,340	603
SK 하이닉스	89,900	-4.16	270.9	65.0	191,778	15,071	-0.35%	-3,608	-10,610	14,331	26,609	-667
삼성전자	59,500	0.17	820.1	63.5	1,263,815	-16,535	-0.13%	-40,445	-24,218	67,233	89,252	4,689
LG 이노텍	287,500	0.70	60.7	61.0	12,639	-4,142	0.04%	629	4,629	-5,258	-3,786	-1,591
LG 디스플레이	13,100	1.16	23.2	60.7	248,458	-15,461	-0.34%	-23,518	23,759	-1,921	-2,812	-3,190
엔씨소프트	378,000	-0.79	13.3	60.0	4,861	126	-0.15%	-215	207	6	123	-159
기아	66,300	1.22	44.9	57.2	50,187	-2,483	0.18%	-2,435	227	2,059	-5,182	-2,613
일진머티리얼즈	58,600	4.09	13.8	56.4	42,266	755	0.07%	272	2,427	-2,650	-2,726	76
한화솔루션	51,400	6.53	163.3	54.7	67,904	-4,234	-0.15%	-9,301	7,454	417	936	-351

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터