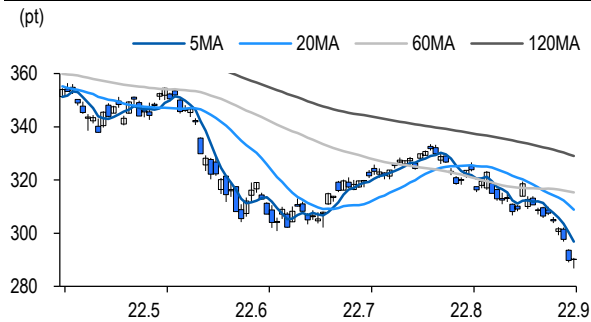


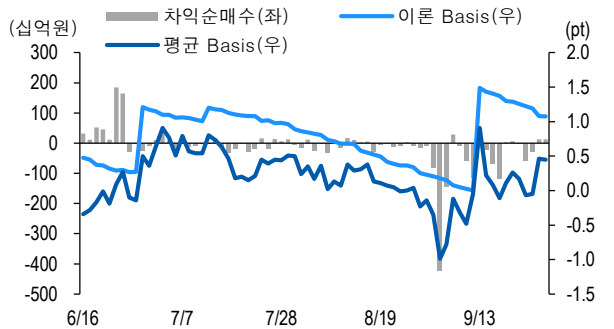
선물옵션시장 지표

2022.9.28

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	290.20	0.15	0.43	6,161.7	-
선물 12월물	290.60	0.10	0.30	28,158.5	342,653
선물 3월물	288.50	0.07	0.20	48.8	9,381
10월물(mini)	289.70	0.15	0.42	1,933.8	102,763
11월물(mini)	290.00	0.08	0.24	13.4	9,126

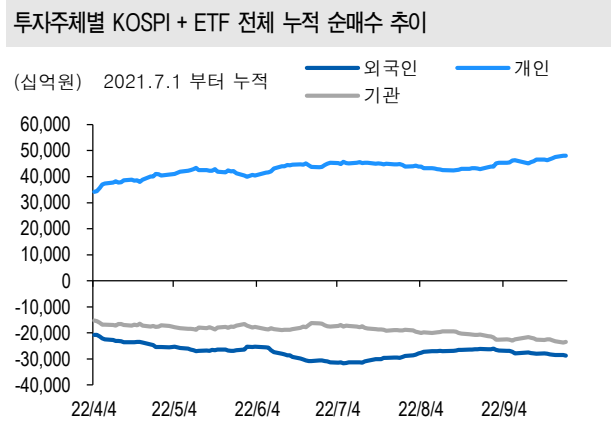


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	1.08	0.45	0.40	-0.22%
베이스(mini)	0.40	-0.53	-0.50	-0.32%
제1스프레드(SP)	-2.65	-1.99	-2.00	0.23%
합성선물 베이스(ATM)	0.40	-0.59	-0.59	-0.34%

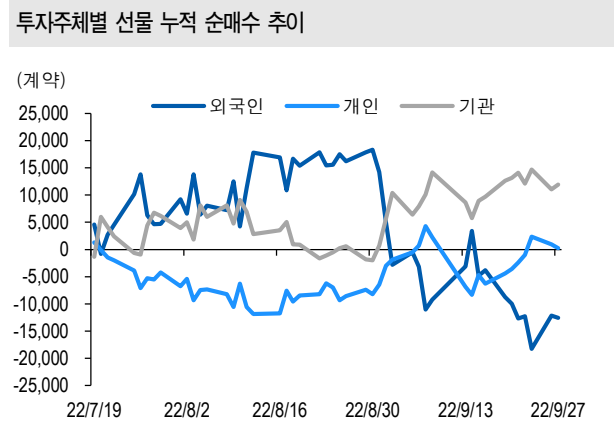


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-246.1	18.3	-227.8	-7.7	-180.7	-25.9	-6.4	-3.3	-2.6	14.3
개인	-16.7	31.5	14.8	0.0	-2.4	-36.7	-13.2	-1.5	8.5	-20.7
기관	245.9	-46.5	199.3	20.1	-78.9	42.7	20.3	5.2	-7.4	5.3
금융투자	313.1	23.7	336.8	15.7	-2.9	8.0	19.7	7.8	-6.9	19.0
투신	6.4	-33.2	-26.8	0.0	-15.3	60.1	2.5	-0.7	-0.3	-11.2
은행+보험+기타금융	0.5	-31.9	-31.4	0.0	0.4	-27.8	-2.0	-1.9	-0.2	-9.3
연기금+국가자재	-65.2	-3.8	-68.9	2.9	-57.5	2.3	0.0	0.0	0.0	6.7
기타법인	17.0	-3.3	13.7	0.0	0.1	19.9	-0.7	-0.4	1.6	1.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



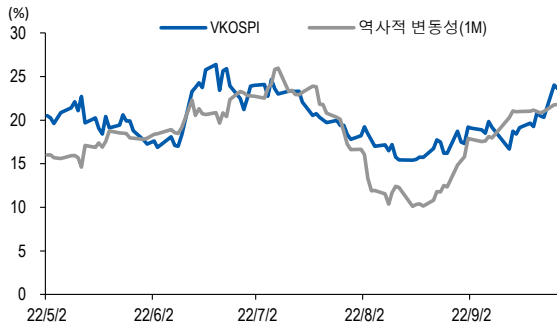
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,116,284	277.3	1,224,682	20.0%	지수옵션 전체	2,169,865	663.7	2,811,802
Put	1,053,581	386.4	1,587,120	23.2%	PCR(금액기준)	1.39	VKOSPI	23.62%(-0.40%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	297.5(K+3)	2.14	-0.22	81,960	14,585	2,751	20.0	Put	292.5(K+1)	6.85	-0.46	4,263	23,191	-320	21.8
	295.0(K+2)	2.98	-0.14	80,045	16,530	7,913	20.4		290.0(K+0)	5.62	-0.41	16,284	34,364	-167	22.4
	292.5(K+1)	3.95	-0.22	24,783	9,713	4,597	20.5		287.5(K-1)	4.47	-0.52	13,072	18,993	-121	22.5
	290.0(K+0)	5.23	0.05	17,162	7,903	3,106	21.2		285.0(K-2)	3.54	-0.46	31,305	26,456	-1,466	22.9
	287.5(K-1)	6.58	-0.38	6,225	2,909	1,885	21.3		282.5(K-3)	2.79	-0.42	33,289	22,628	-214	23.4

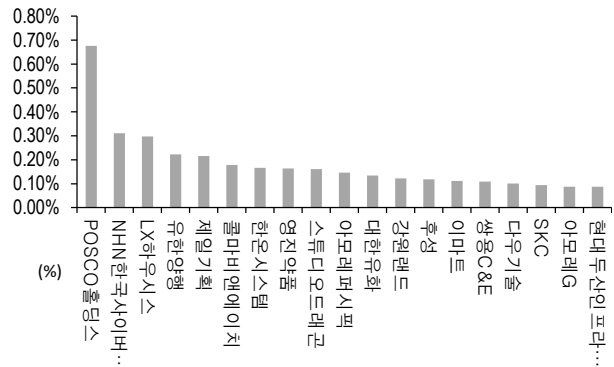
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,422,629	2,552.4	4,303,012	12,572	1,079	-75,286	73,406	14.3	-20.7	5.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	186,500	1.91	138.5	86.7	48,494	50	-0.01%	-3,889	1,882	1,935	1,343	892
LG 화학	572,000	0.00	91.1	81.0	8,530	-432	-0.03%	-401	-195	598	294	309
삼성전기	120,000	-0.83	43.5	77.4	32,308	-660	-0.02%	-999	767	227	-133	360
삼성전자	53,900	1.13	663.7	77.2	1,133,461	-9,241	-0.11%	25,126	-9,329	-15,652	3,674	4,000
현대엘리베이	23,900	3.02	2.6	73.0	2,791	-524	-0.30%	-138	-327	465	465	0
현대제철	30,000	0.67	10.8	71.4	16,270	-400	0.03%	-1,730	191	1,538	908	630
넥센타이어	7,360	3.08	1.7	69.5	8,804	-2,315	-0.08%	-1,425	-179	1,618	1,624	-6
한화솔루션	48,000	3.23	88.5	69.4	104,808	-9,810	-0.02%	-10,064	-13,207	23,210	21,562	1,540
현대건설	39,700	1.79	15.3	67.9	21,001	-1,420	-0.09%	-1,572	264	1,308	3,728	-1,265
호텔신라	73,300	1.38	10.4	63.8	14,909	1,203	-0.13%	2,964	-2,318	-647	-629	-18

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터