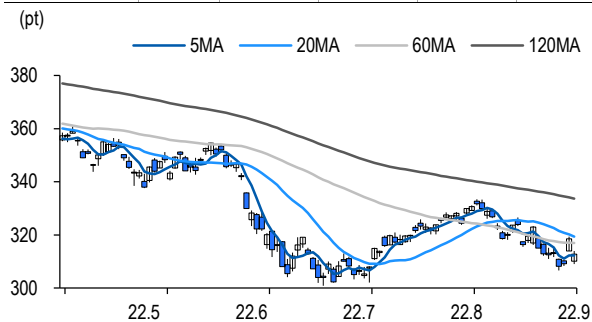


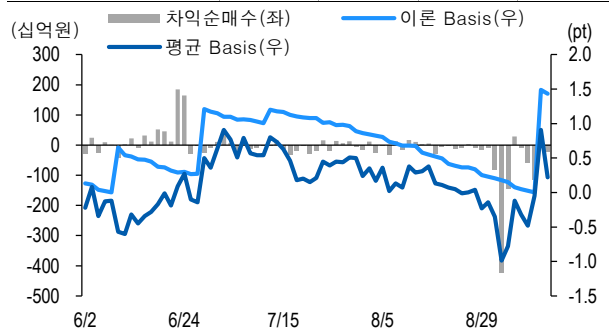
선물옵션시장 지표

2022.9.15

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.74	-1.83	-5.82	5,592.9	-
선물 12월물	312.70	-2.34	-7.50	29,653.8	287,782
선물 3월물	310.90	-2.25	-7.15	38.1	5,217
10월물(mini)	312.08	-2.24	-7.14	2,238.3	83,565
11월물(mini)	312.50	-2.12	-6.78	5.7	7,031



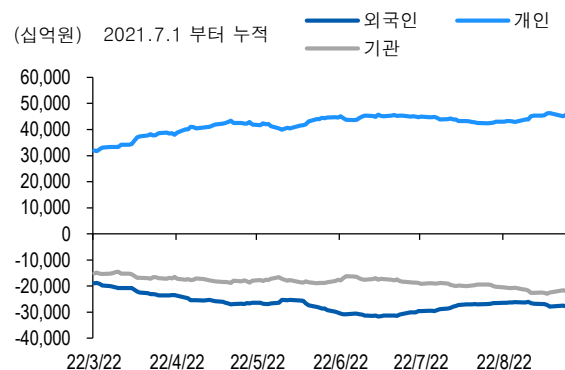
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.43	0.22	-0.04	-0.39%
베이스(mini)	0.73	-0.49	-0.66	-0.39%
제1스프레드(SP)	-2.59	-1.99	-1.95	0.19%
합성선물 베이스(ATM)	0.73	-0.61	-0.61	-0.43%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-163.0	-32.6	-195.6	-6.6	-180.4	518.1	-9.3	5.9	-2.2	-40.2
개인	389.2	107.8	497.0	0.0	-1.2	-108.5	-0.1	-4.5	-3.9	18.0
기관	-239.6	-77.2	-316.8	-15.1	26.3	-244.3	15.8	-1.3	7.1	22.7
금융투자	-303.7	-80.3	-384.0	-5.7	1.5	433.6	14.5	0.0	7.4	36.0
투신	-5.9	-33.0	-39.0	0.0	-12.4	-633.4	1.3	-0.2	-0.2	-20.4
은행+보험+기타금융	-2.3	11.4	9.0	0.0	1.0	-27.9	0.0	-1.2	-0.2	0.4
연기금+국가지자체	142.8	2.1	144.9	3.1	50.3	-16.7	0.0	0.0	0.0	6.7
기타법인	13.4	2.0	15.3	0.0	-0.2	-165.3	-6.4	-0.1	-1.1	-0.4

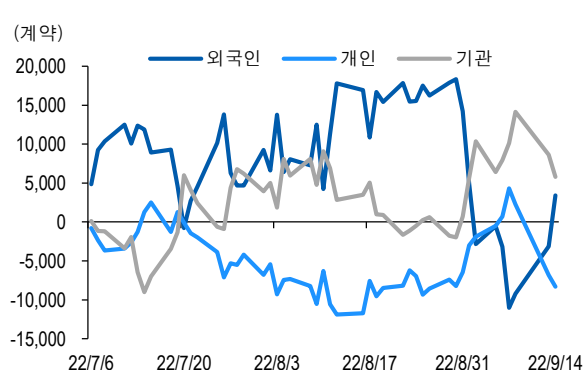
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



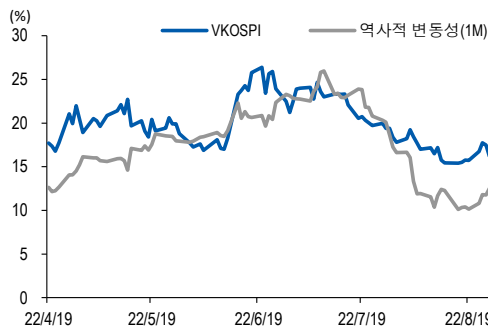
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성		거래량		거래대금		미결제약정		
Call	980,033		274.5		728,619		15.2%	지수옵션 전체	2,139,678		660.8		1,976,471		
Put	1,159,645		386.3		1,247,852		18.4%		PCR(금액기준)	1.41		VKOSPI		18.73%(+2.05%p)	

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	1.38	-1.64	112,622	26,887	5,776	14.9	Put	320.0(K+1)	10.65	4.55	1,897	6,466	640	17.8
	322.5(K+2)	1.97	-2.12	85,886	16,019	4,461	15.2		317.5(K+0)	9.00	4.00	3,164	3,278	51	17.7
	320.0(K+1)	2.70	-2.61	79,650	19,079	-1,220	15.4		315.0(K-1)	7.61	3.51	8,362	8,351	-562	18.0
	317.5(K+0)	3.63	-3.07	46,153	11,022	2,843	15.8		312.5(K-2)	6.38	3.08	11,658	7,353	288	18.3
	315.0(K-1)	4.71	-3.65	25,500	10,771	2,580	16.0		310.0(K-3)	5.31	2.63	21,649	19,255	1,791	18.6

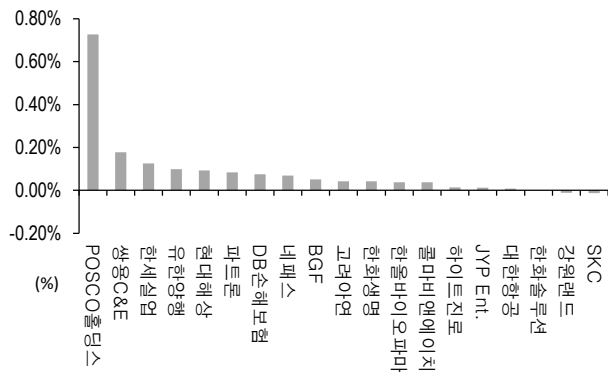
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)											(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	3,016,765	2,114.5	3,754,351	43,138	-54,710	50,404	4,497	-40.2	18.0	22.7		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	200,000	-0.74	131.5	99.6	44,144	-2,324	-0.12%	1,113	-2,432	1,319	1,641	-182
엔씨소프트	374,000	-2.86	22.8	84.0	6,328	940	-0.03%	912	144	-1,056	-971	-75
코스맥스	60,400	-1.95	1.4	72.9	1,940	221	-0.21%	493	-238	-255	-265	10
삼성전자	56,800	-1.90	496.3	70.1	1,059,676	-15,743	-0.11%	-44,173	16,541	27,643	27,068	3,710
SK 하이닉스	93,000	-1.90	148.7	67.3	161,305	-2,901	-0.35%	-2,638	-1,594	4,497	6,542	140
삼성전기	139,500	-3.46	56.7	56.8	27,806	-1,951	-0.13%	-3,316	3,714	-387	-990	1,500
LG 화학	664,000	-0.30	87.5	56.0	8,507	89	-0.19%	-200	-88	284	434	-150
한샘	51,000	-0.97	1.6	54.5	1,713	256	-1.25%	72	190	-262	-262	0
호텔신라	71,700	-1.78	5.3	53.4	11,255	285	-0.08%	1,620	-498	-1,072	-1,291	219
일진머티리얼즈	66,800	-2.91	9.8	53.0	46,841	1,104	-0.03%	714	604	-1,318	-1,036	-279

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터