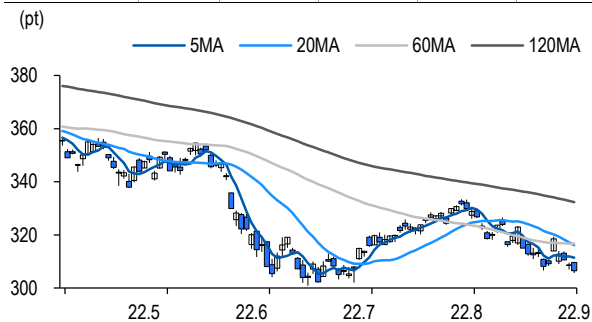


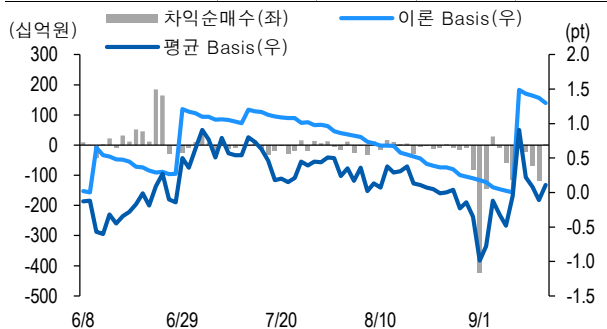
선물옵션시장 지표

2022.9.20

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	306.49	-0.71	-2.20	4,835.8	-
선물 12월물	306.90	-0.32	-1.00	18,381.7	301,909
선물 3월물	304.75	-0.39	-1.20	71.7	6,570
10월물(mini)	306.16	-0.42	-1.30	1,375.5	80,532
11월물(mini)	306.56	-0.20	-0.60	3.1	6,849



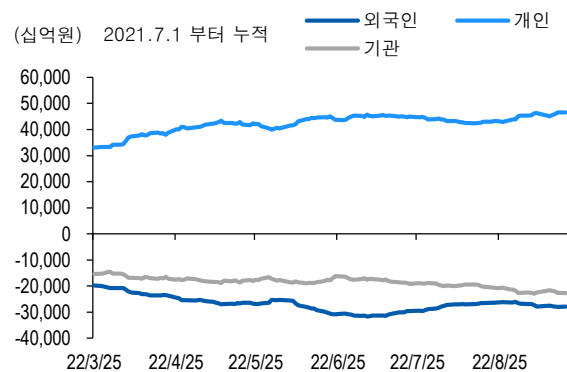
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.30	0.11	0.41	-0.39%
베이스(mini)	0.60	-0.55	-0.33	-0.38%
제1스프레드(SP)	-2.60	-1.88	-1.85	0.24%
합성선물 베이스(ATM)	0.60	-0.33	-0.33	-0.30%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	0.7	24.2	24.9	1.6	130.7	-341.4	-39.6	-0.9	-0.4	-0.4
개인	27.8	23.0	50.8	0.0	-0.7	127.5	20.8	-0.9	0.6	-10.4
기관	-41.9	-47.7	-89.5	1.6	-20.0	208.0	19.5	2.2	-0.6	9.9
금융투자	66.4	-46.3	20.0	0.0	0.1	225.4	19.7	3.1	-0.6	14.4
투신	-20.3	-6.2	-26.4	0.0	-5.9	-15.8	-0.2	0.0	0.0	-4.7
은행+보험+기타금융	-10.7	13.2	2.5	0.0	-4.0	19.7	0.0	-0.8	0.0	0.0
연기금+국가자재	-28.2	-0.1	-28.3	1.6	-11.2	-21.3	0.0	0.0	0.0	0.2
기타법인	13.4	0.4	13.8	0.0	-1.0	5.9	-0.7	-0.5	0.4	0.9

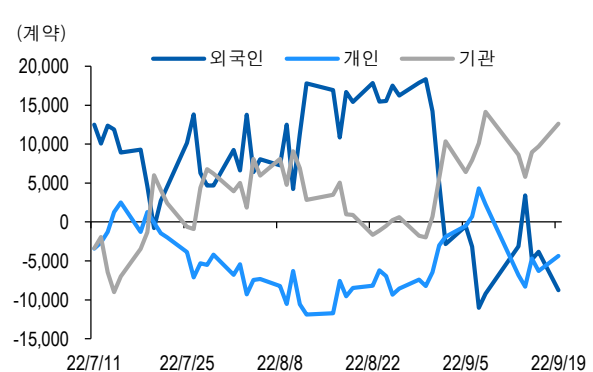
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



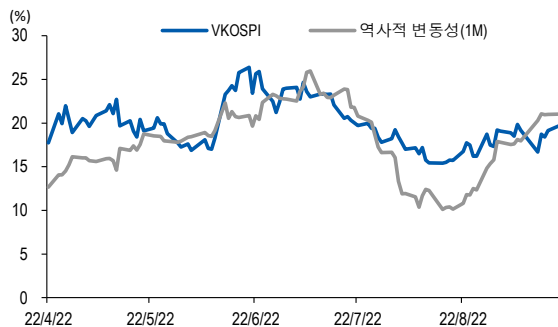
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	575,041	171.9	859,635	16.4%	지수옵션 전체	1,198,670	396.8	2,242,412
Put	623,629	224.9	1,382,777	19.2%	PCR(금액기준)	1.31	VKOSPI	19.64%(+0.51%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	315.0(K+3)	2.08	-0.58	53,178	17,028	2,210	16.4	Put	310.0(K+1)	7.67	0.41	4,056	21,022	180	17.8
	312.5(K+2)	2.91	-0.68	22,468	10,178	1,847	16.8		307.5(K+0)	6.37	0.35	6,458	16,731	343	18.2
	310.0(K+1)	3.85	-0.84	11,486	8,379	1,467	17.0		305.0(K-1)	5.22	0.23	13,251	21,300	416	18.5
	307.5(K+0)	5.03	-0.93	6,139	4,657	612	17.4		302.5(K-2)	4.25	0.16	16,112	15,800	715	18.9
	305.0(K-1)	6.39	-0.97	3,801	3,030	1,405	17.8		300.0(K-3)	3.45	0.14	27,767	21,804	-482	19.4

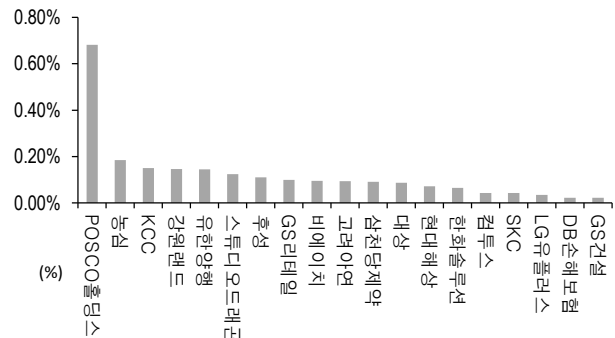
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,806,797	1,890.9	3,889,443	-15,461	4,828	-25,089	19,114	-0.4	-10.4	9.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	201,500	-0.25	128.5	94.5	46,459	-430	-0.10%	1,063	-386	-687	139	-826
LG 화학	635,000	0.00	78.8	72.9	8,417	-363	-0.15%	-355	-278	630	455	175
삼성전자	56,000	0.18	498.7	72.5	1,099,565	-5,649	-0.02%	5,463	218	-5,671	-16,994	-1,130
삼성 SDI	608,000	0.66	74.6	72.4	12,966	-888	-0.17%	-601	-758	1,374	613	764
일진머티리얼즈	63,200	-2.47	10.7	68.0	43,213	-553	-0.11%	240	-1,046	806	1,464	-658
SK 하이닉스	90,200	-0.33	119.4	66.5	160,071	-3,840	-0.22%	-1,406	5,773	-4,592	-4,474	-2,591
KT	35,800	-0.56	12.6	64.0	57,871	-3,237	-0.12%	5,269	617	-5,885	-4,770	-1,115
현대모비스	209,500	-0.48	11.1	61.0	3,577	-390	-0.14%	-1,018	118	909	759	150
삼성전기	129,000	-1.53	24.9	57.9	34,495	-30	-0.09%	-940	-174	1,092	482	-9
유한양행	56,000	0.36	1.7	56.8	20,111	2,392	0.15%	-603	2,311	-1,708	-1,682	-26

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터