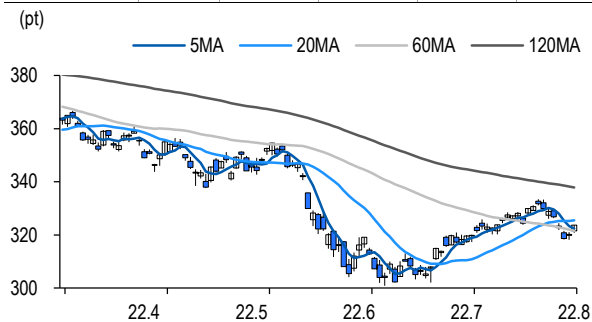


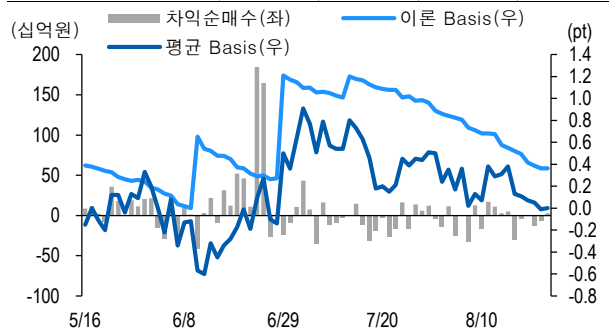
선물옵션시장 지표

2022.8.26

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	323.63	1.18	3.77	5,240.5	-
선물 9월물	323.85	1.33	4.25	17,630.1	302,154
선물 12월물	325.05	1.31	4.20	111.7	21,362
9월물(mini)	323.90	1.35	4.22	1,110.3	53,571
10월물(mini)	323.88	1.30	4.16	8.0	22,110



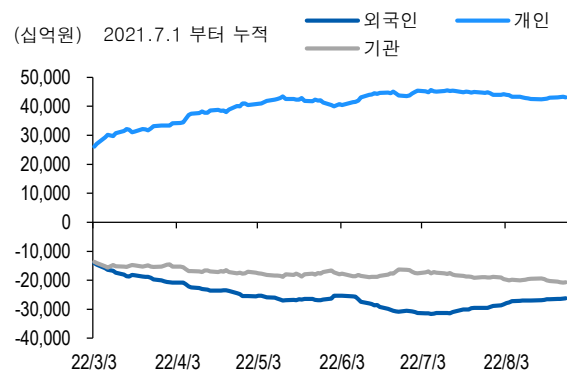
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.36	0.00	0.22	-0.11%
베이스(mini)	0.36	0.00	0.27	-0.11%
제1스프레드(SP)	1.52	1.19	1.20	-0.10%
합성선물 베이스(ATM)	0.36	0.26	0.26	-0.03%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	41.6	-6.3	35.2	0.6	78.8	146.8	8.7	1.7	-0.3	-6.8
개인	-179.9	38.2	-141.7	0.0	0.8	-159.1	-32.2	-1.8	-0.9	0.1
기관	119.6	-29.2	90.4	2.2	-16.3	39.8	23.3	-0.1	1.4	6.0
금융투자	62.6	-73.8	-11.3	-1.0	-1.1	-145.2	24.0	-1.1	1.4	-25.9
투신	0.4	-9.3	-8.9	0.0	-3.7	186.6	-0.6	-0.1	0.0	37.8
은행+보험+기타금융	-2.9	41.5	38.6	0.0	-3.0	-1.0	-0.1	1.1	0.0	0.0
연기금+국가지자체	33.8	9.7	43.5	3.2	-2.4	-0.5	0.0	0.0	0.0	-5.8
기타법인	18.8	-2.7	16.1	0.0	0.6	-27.6	0.2	0.1	-0.3	0.6

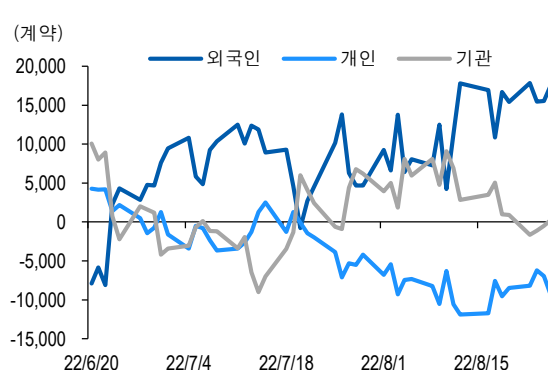
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	581,015	185.6	863,738	13.6%	지수옵션 전체	1,301,708	353.7	2,240,925
Put	720,693	168.1	1,377,187	16.5%	PCR(금액기준)	0.91	VKOSPI	16.19%(-1.29%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	2.10	0.93	95,026	16,713	-2,895	13.6	Put	322.5(K+1)	3.19	-2.55	10,710	10,416	-2	14.9
	325.0(K+2)	3.20	1.29	77,632	18,301	487	14.0		320.0(K+0)	2.32	-2.15	30,179	30,701	1,407	15.4
	322.5(K+1)	4.57	1.68	22,208	8,661	992	14.5		317.5(K-1)	1.68	-1.78	38,258	18,244	507	16.0
	320.0(K+0)	6.21	2.13	10,117	13,292	1,339	15.0		315.0(K-2)	1.19	-1.41	69,726	25,264	146	16.5
	317.5(K-1)	8.07	2.53	3,712	2,375	191	15.5		312.5(K-3)	0.81	-1.15	78,136	23,951	1,904	16.9

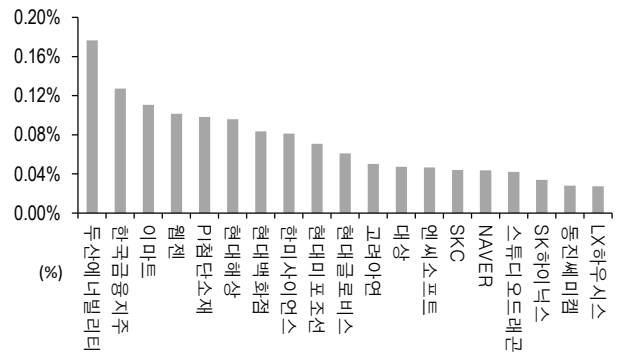
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)			
주식선물 전체		거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	금융투자	연기금등
		2,638,037	1,634.6	4,108,045	82,180	7,003	-30,873	23,954	-6.8	0.1	6.0	순매수	순매수

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	192,000	2.40	81.9	78.3	42,998	1,300	-0.05%	426	939	-1,375	-1,621	-204
SK 하이닉스	94,200	0.96	139.5	72.0	181,520	1,648	0.03%	9,989	-9,453	-739	-6,340	-1,877
삼성전자	59,700	1.19	240.1	70.6	1,032,052	-11,235	-0.09%	-7,941	-3,965	11,829	13,604	2,400
엔씨소프트	370,500	2.63	13.2	66.0	8,754	284	0.05%	580	78	-658	1	-693
BGF	4,180	1.46	0.6	62.7	4,585	292	-0.12%	-271	-333	604	604	0
KT	38,600	-0.26	11.4	59.0	52,551	655	-0.16%	-1,786	-760	2,646	2,712	-68
삼성전기	137,000	1.86	19.0	58.4	27,957	-465	-0.05%	-324	-1,008	1,332	690	40
SK 이노베이션	205,000	-0.24	29.6	58.0	18,870	-861	-0.04%	214	-408	167	-93	310
현대제철	32,850	1.86	3.8	52.3	15,321	2,000	-0.07%	2,815	-2,339	-476	-1,150	674
삼성 SDI	588,000	-0.51	57.5	52.2	13,173	20	-0.02%	-764	1,000	-347	-128	-206

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터