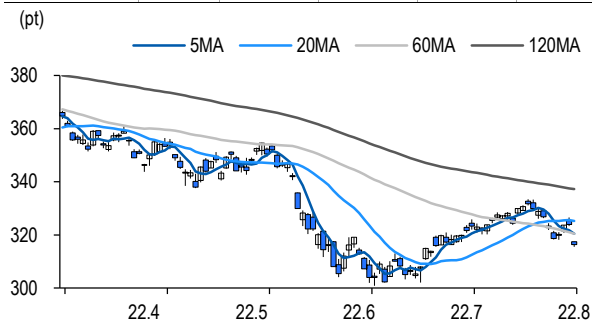


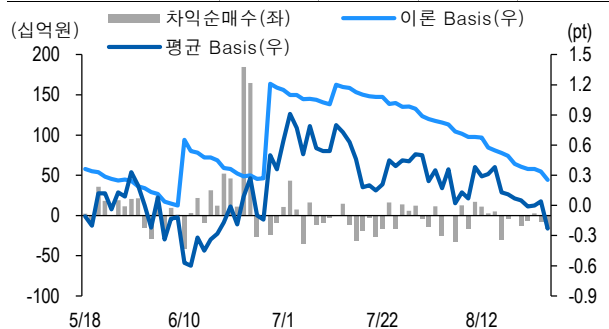
선물옵션시장 지표

2022.8.30

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.35	-2.33	-7.56	5,881.0	-
선물 9월물	315.70	-2.71	-8.80	18,196.2	304,975
선물 12월물	317.10	-2.55	-8.30	168.1	22,636
9월물(mini)	315.72	-2.71	-8.78	1,101.9	53,527
10월물(mini)	315.94	-2.56	-8.30	14.3	26,698



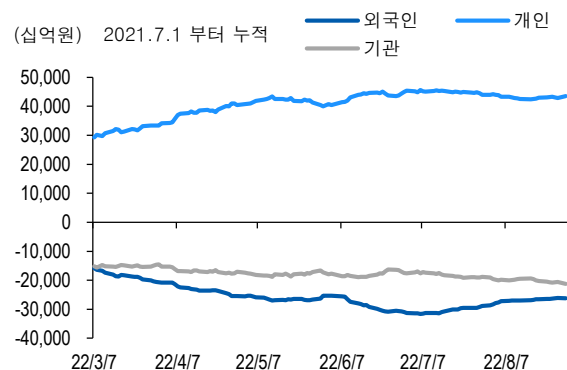
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.25	-0.23	-0.65	-0.15%
베이스(mini)	0.25	-0.23	-0.63	-0.15%
제1스프레드(SP)	1.59	1.19	1.20	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.25	-0.53	-0.53	-0.25%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-57.1	-46.1	-103.1	-2.8	-121.9	118.7	5.7	2.6	-6.7	0.3
개인	599.6	131.6	731.2	0.0	-0.1	76.4	19.5	-4.2	10.3	-31.5
기관	-558.8	-79.5	-638.3	-13.2	-24.8	-162.1	-27.2	2.4	-4.9	32.2
금융투자	-383.6	-104.8	-488.4	-5.3	-1.9	194.8	-27.5	2.6	-4.6	36.8
투신	-40.1	-15.6	-55.7	0.0	-22.5	-359.2	0.3	-0.2	0.1	-8.5
은행+보험+기타금융	-20.6	17.0	-3.6	0.0	-12.5	-6.4	-0.1	0.0	-0.3	-0.3
연기금+국가지자체	5.5	12.9	18.4	-7.9	11.0	8.6	0.0	0.0	0.0	4.2
기타법인	16.3	-6.1	10.2	0.0	1.1	-33.0	2.0	-0.8	1.3	-0.9

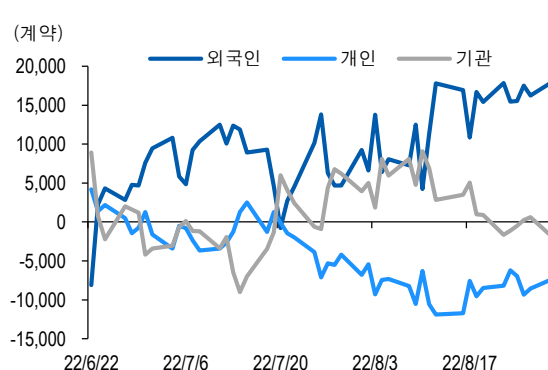
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



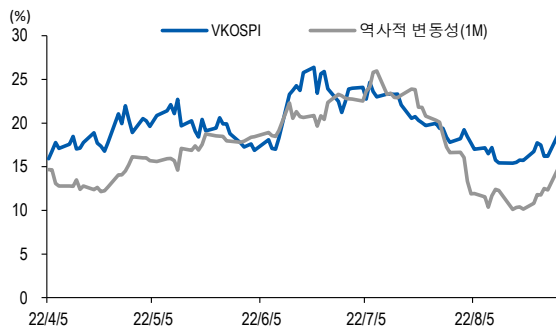
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	777,865	149.5	923,187	14.7%	지수옵션 전체	1,570,743	421.9	2,384,967
Put	792,878	272.4	1,461,780	19.4%	PCR(금액기준)	1.82	VKOSPI	18.72%(+2.53%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	332.5(K+3)	0.10	-0.62	43,978	22,019	-1,729	15.0	Put	327.5(K+1)	11.90	6.68	1,123	7,049	-404	20.4
	330.0(K+2)	0.16	-1.17	67,476	35,882	4,197	14.3		325.0(K+0)	9.78	5.89	3,177	16,731	-201	19.8
	327.5(K+1)	0.31	-1.84	100,822	28,486	12,089	14.2		322.5(K-1)	7.83	4.98	5,440	11,012	-626	19.3
	325.0(K+0)	0.60	-2.76	131,582	33,386	15,189	14.3		320.0(K-2)	6.14	4.07	13,612	30,513	-1,616	19.3
	322.5(K-1)	1.14	-3.71	97,133	16,516	8,555	14.8		317.5(K-3)	4.64	3.18	16,482	22,438	-189	19.1

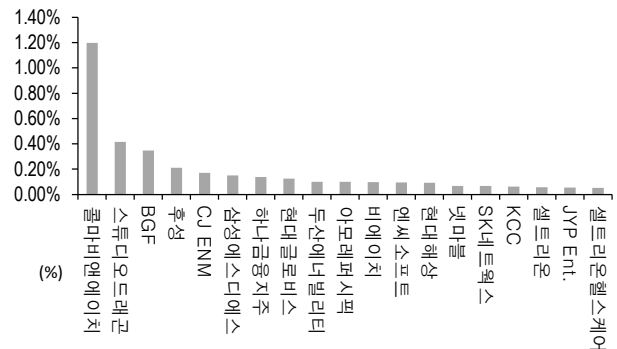
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)			
주식선물 전체		거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	금융투자	연기금등
		2,762,648	1,802.9	4,196,464	-20,161	-6,234	-65,051	71,656	0.3	-31.5	32.2		

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	188,000	-2.84	99.1	88.0	39,916	-1,602	-0.11%	-1,078	-1,264	2,342	2,448	-90
현대제철	32,350	-2.12	8.3	76.6	13,288	-1,898	-0.02%	225	2,067	-2,291	-2,825	539
호텔신라	72,000	-1.37	8.0	70.5	13,336	37	-0.03%	1,204	-328	-877	-1,101	99
삼성 SDI	576,000	-1.87	52.8	63.4	12,392	-584	0.00%	904	-90	-764	-583	-138
코스맥스	61,300	-2.85	1.8	63.2	2,126	186	-0.33%	281	110	-391	-391	0
LG 화학	603,000	-2.11	69.1	62.6	7,092	-215	-0.22%	157	-471	319	293	40
일진머티리얼즈	70,500	-3.95	11.4	55.4	48,994	235	-0.06%	1,923	-946	-977	-19	-958
삼성전자	58,700	-2.17	317.3	55.1	1,028,701	5,437	-0.05%	-7,525	-32,893	40,388	32,778	7,250
SK 이노베이션	195,500	-3.93	36.7	54.2	15,845	-3,094	-0.16%	-136	1,016	-880	988	1,103
기아	77,400	-2.03	28.3	48.9	35,906	-4,608	-0.20%	2,609	799	-3,408	4,158	-10

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터