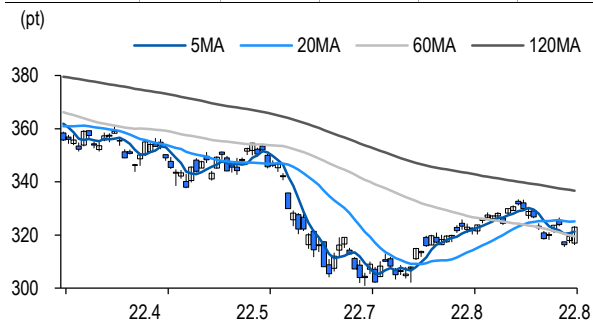


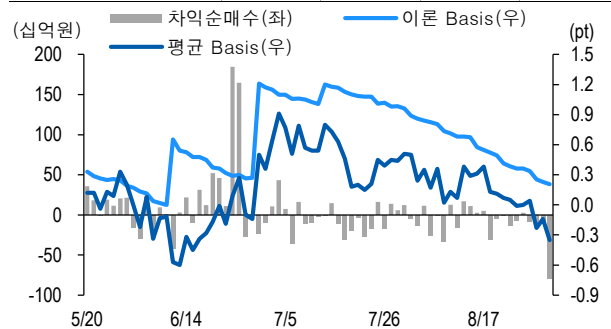
선물옵션시장 지표

2022.9.1

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	322.96	1.09	3.47	7,005.9	-
선물 9월물	321.00	0.49	1.55	23,315.4	317,029
선물 12월물	322.45	0.58	1.85	299.9	28,203
9월물(mini)	320.92	0.46	1.44	1,714.9	56,643
10월물(mini)	321.16	0.58	1.86	17.9	29,891



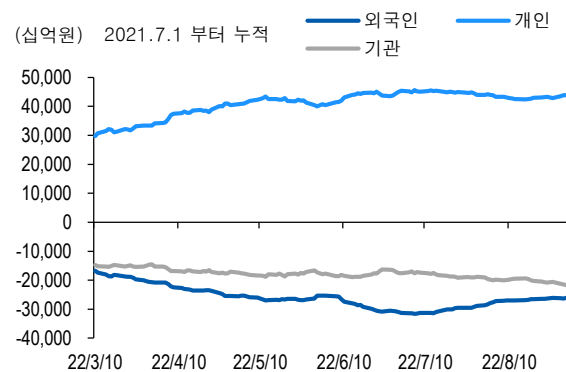
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.21	-0.35	-1.96	-0.17%
베이스(mini)	0.21	-0.35	-2.04	-0.17%
제1스프레드(SP)	1.65	1.17	1.20	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.21	-2.03	-2.03	-0.69%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	214.8	-0.6	214.3	-23.3	366.6	-374.6	41.9	-5.8	-1.6	-25.9
개인	43.2	5.6	48.8	0.0	0.9	160.9	-17.3	7.0	0.0	-5.6
기관	-272.2	-6.9	-279.1	-56.1	3.1	235.6	-23.3	-2.1	3.0	32.7
금융투자	-212.7	2.9	-209.8	-41.6	7.6	239.5	-19.4	-1.8	3.3	48.8
투신	-32.5	-36.2	-68.8	0.0	-18.0	6.3	-3.9	-0.3	0.0	-29.4
은행+보험+기타금융	-0.8	9.4	8.6	0.0	5.2	-6.9	0.0	0.0	-0.4	0.0
연기금+국가지자체	-20.5	8.4	-12.2	-1.6	9.2	-3.4	0.0	0.0	0.0	13.3
기타법인	14.2	1.9	16.1	0.0	0.4	-21.8	-1.3	0.9	-1.4	-1.1

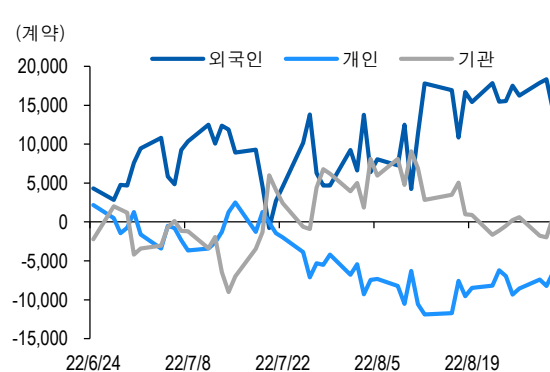
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,293,182		314.7		965,770		9.9%		지수옵션 전체	2,525,081		612.6		2,490,059	
Put	1,231,899		298.0		1,524,289		20.6%			PCR(금액기준)	0.95		VKOSPI		17.31%(−0.16%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	0.70	0.24	257,754	29,494	−4,356	10.9	Put	322.5(K+1)	3.87	−0.99	15,396	13,445	1,544	20.8
	325.0(K+2)	1.31	0.34	255,891	29,662	−8,400	10.3		320.0(K+0)	2.68	−0.86	41,392	31,577	1,025	20.3
	322.5(K+1)	2.43	0.60	161,409	13,431	−2,622	10.2		317.5(K−1)	1.80	−0.72	73,294	24,436	1,506	20.0
	320.0(K+0)	3.61	0.63	94,127	18,258	1,128	7.5		315.0(K−2)	1.22	−0.53	136,459	33,326	6,184	20.4
	317.5(K−1)	5.27	0.81	33,854	10,364	1,433	0.3		312.5(K−3)	0.80	−0.41	175,984	38,020	11,469	20.7

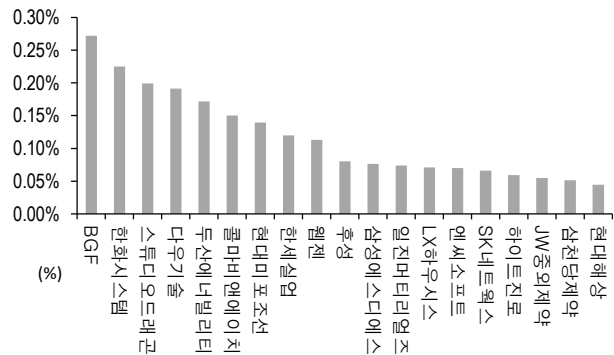
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배출 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,256,605	2,118.7	4,448,370	190,529	-34,262	33,127	2,261	-25.9	-5.6	32.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	195,500	0.00	99.9	71.9	42,544	691	-0.09%	-3,243	305	3,138	3,640	-558
SK 하이닉스	94,900	1.82	154.5	70.7	178,188	-1,088	-0.11%	6,237	1,229	-7,409	-5,409	-272
삼성전자	59,500	1.02	555.0	69.4	1,064,664	35,461	-0.05%	-30,805	-5,039	35,814	17,175	18,686
LG 이노텍	343,500	2.54	50.4	53.3	6,249	-112	0.01%	430	429	-861	-695	-166
LG 전자	100,000	2.46	34.7	49.5	22,239	437	-0.12%	-943	1,461	-518	-894	376
엔씨소프트	377,500	1.48	14.1	48.6	9,131	90	0.07%	-39	26	13	-135	151
한국항공우주	60,900	1.84	43.6	45.2	36,710	-1,524	-0.02%	-311	-185	448	-1,931	2,379
일진머티리얼즈	74,400	1.50	9.4	44.7	49,879	567	0.07%	2,181	-1,246	-915	-845	-70
현대제철	32,950	-0.15	4.9	44.0	13,148	-113	-0.01%	258	471	-729	-957	228
호텔신라	73,800	-0.27	10.8	43.1	13,638	-81	-0.10%	767	-1,130	363	329	44

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터