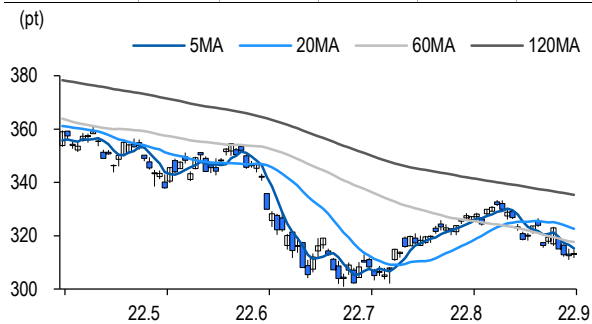


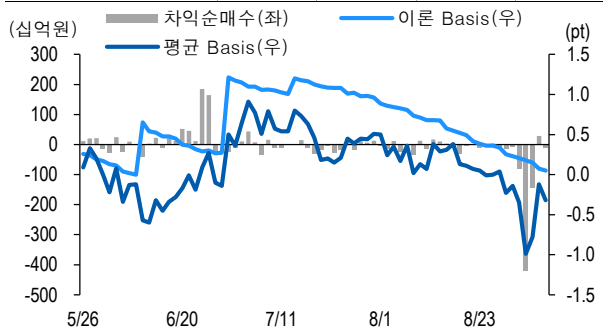
선물옵션시장 지표

2022.9.7

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.01	0.17	0.54	3,784.7	-
선물 9월물	312.90	0.26	0.80	19,386.2	222,645
선물 12월물	313.50	0.24	0.75	3,115.9	172,932
9월물(mini)	313.00	0.29	0.92	1,350.5	61,629
10월물(mini)	312.80	0.10	0.32	53.4	41,345



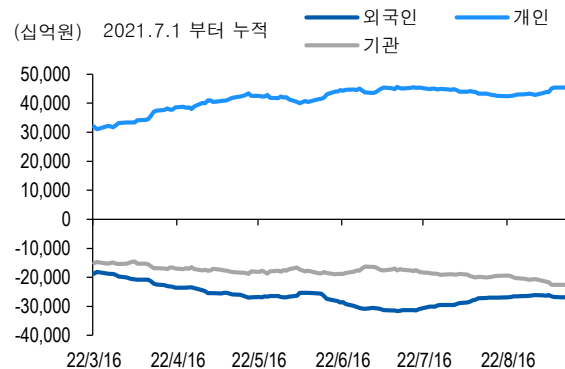
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.05	-0.32	-0.11	-0.12%
베이스(mini)	0.05	-0.32	-0.01	-0.12%
제1스프레드(SP)	1.57	0.82	0.75	-0.24%
합성선물 베이스(ATM)	0.05	0.05	0.05	0.00%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-79.4	33.6	-45.8	0.7	-54.8	-236.4	25.2	2.6	3.6	1.8
개인	85.4	-6.5	78.9	0.0	-0.2	113.0	-17.6	-2.3	-1.6	44.2
기관	-13.2	-25.5	-38.8	-10.3	-9.1	129.5	-7.4	1.0	-1.5	-47.6
금융투자	-27.9	-11.4	-39.3	-2.5	-1.2	304.3	-9.4	1.6	0.1	-77.2
투신	23.5	-16.7	6.7	0.0	-0.4	-150.7	1.3	-0.2	0.0	19.7
은행+보험+기타금융	5.0	1.9	6.8	0.0	8.3	-32.9	0.6	-0.4	-1.6	-0.1
연기금+국가지자체	-11.0	-1.0	-11.9	-7.8	-14.3	8.8	0.0	0.0	0.0	10.0
기타법인	7.3	-1.6	5.7	0.0	-0.4	-6.1	-0.2	-1.4	-0.5	1.6

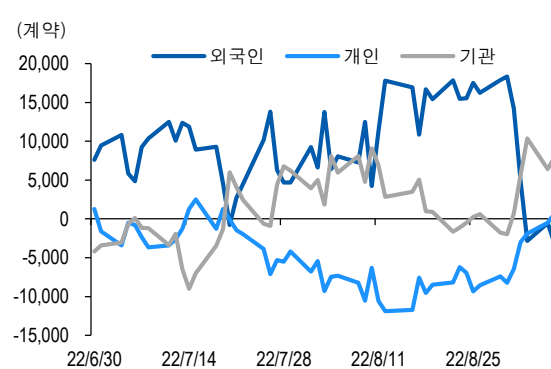
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



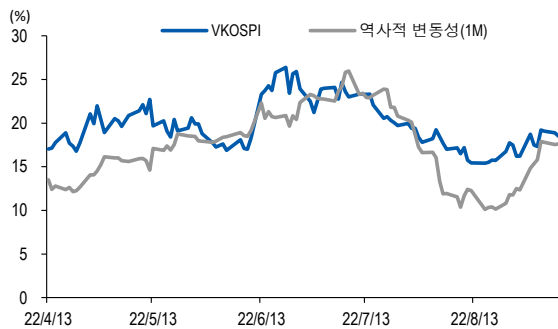
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,707,980	307.4	1,353,671	15.4%	지수옵션 전체	3,485,095	634.3	3,213,921
Put	1,777,115	326.9	1,860,250	17.9%	PCR(금액기준)	1.06	VKOSPI	18.49%(-0.38%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	320.0(K+3)	0.10	-0.03	268,812	58,666	-1,410	15.0	Put	315.0(K+1)	2.89	-0.96	66,544	29,132	-24	15.6
	317.5(K+2)	0.33	-0.07	462,279	49,497	8,160	14.9		312.5(K+0)	1.62	-0.78	187,358	27,052	-38	16.8
	315.0(K+1)	0.96	-0.08	400,339	27,779	3,593	15.4		310.0(K-1)	0.80	-0.64	339,132	42,775	4,457	17.5
	312.5(K+0)	2.18	0.08	192,192	14,435	3,352	16.6		307.5(K-2)	0.34	-0.46	336,860	46,616	5,136	17.9
	310.0(K-1)	3.79	0.18	36,505	11,274	2,198	16.5		305.0(K-3)	0.13	-0.31	325,441	52,506	5,835	18.4

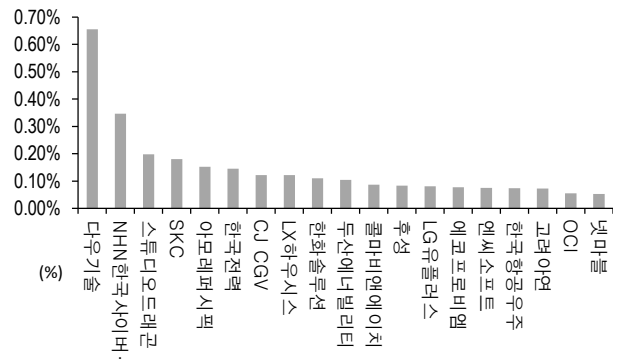
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	2,862,789	1,926.1	5,178,697	152,661	-27,872	63,223	-37,566	1.8	44.2	-47.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	91,800	0.55	150.8	118.8	176,565	-18,086	0.01%	1,042	10,960	-11,984	-12,276	1,140
삼성전자	57,000	-0.18	333.9	78.2	782,897	-192,251	-0.02%	-1,632	25,349	-23,747	-29,347	6,500
현대차	201,000	0.25	89.4	76.0	42,583	-4,924	-0.06%	990	-258	-971	-1,244	253
LG 화학	621,000	0.81	41.9	75.9	8,043	-339	-0.15%	56	-186	51	-34	85
KB 금융	47,950	-0.42	17.2	71.8	48,056	-4,198	-0.07%	-529	976	-447	-4,071	-300
엔씨소프트	374,500	-0.66	10.9	70.7	9,048	-125	0.08%	6	189	-195	-122	-63
하나금융지주	37,900	-0.13	14.9	62.5	69,946	-19,715	0.00%	-833	14	750	11	2,035
삼성전기	139,000	2.21	27.5	62.4	23,198	-4,695	-0.02%	436	-706	198	212	-308
한국조선해양	92,200	0.44	6.1	58.2	8,760	-49	-0.08%	-445	177	268	124	144
POSCO 홀딩스	252,000	-0.40	30.2	57.9	8,979	-1,404	-0.05%	83	780	-931	-1,388	457

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터