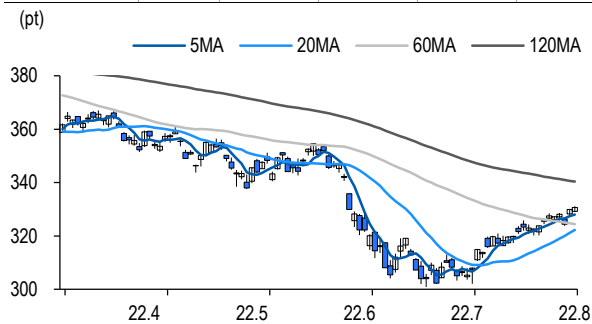


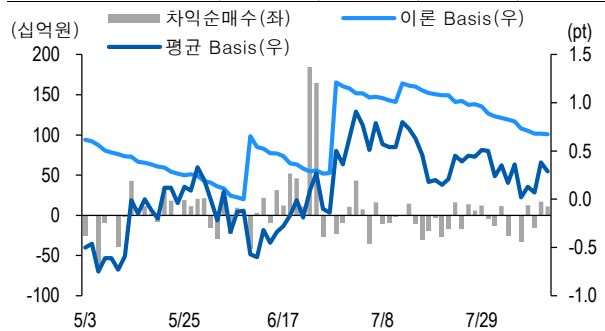
## 선물옵션시장 지표

2022.8.15

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	330.67	0.23	0.75	6,123.2	-
선물 9월물	330.70	0.15	0.50	14,730.3	293,889
선물 12월물	331.80	0.15	0.50	95.6	20,522
9월물(mini)	330.70	0.15	0.58	1,175.8	32,294
10월물(mini)	330.54	0.25	0.84	3.2	1,958



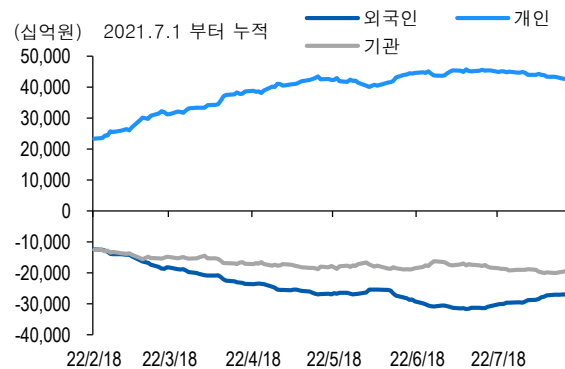
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.68	0.29	0.03	-0.12%
베이스(mini)	0.68	0.29	0.03	-0.12%
제1스프레드(SP)	1.57	-	1.20	-
합성선물 베이스(ATM)	0.68	0.07	0.07	-0.18%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-13.0	-40.9	-53.9	3.8	45.0	416.3	-5.3	0.1	-3.0	16.2
개인	-224.4	65.7	-158.8	0.0	3.3	-111.6	-7.7	-1.8	-1.2	29.9
기관	202.8	-19.8	183.0	7.3	-5.4	-208.1	14.5	1.6	4.6	-48.3
금융투자	176.1	-21.7	154.4	2.3	3.5	-124.2	14.6	1.6	4.8	1.4
투신	21.1	1.1	22.2	0.0	7.9	-105.3	0.0	0.0	-0.1	-4.0
은행+보험+기타금융	-9.2	-7.9	-17.0	0.0	-2.5	26.9	0.0	0.0	-0.1	0.1
연기금+국가지자체	61.2	6.0	67.2	4.9	-14.8	-5.5	0.0	0.0	0.0	-45.8
기타법인	34.6	-4.9	29.7	0.0	0.1	-96.7	-1.4	0.1	-0.4	2.1

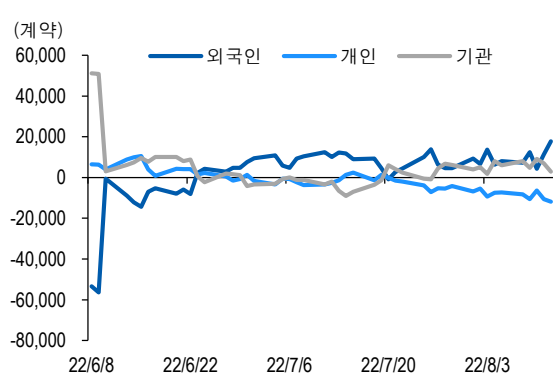
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

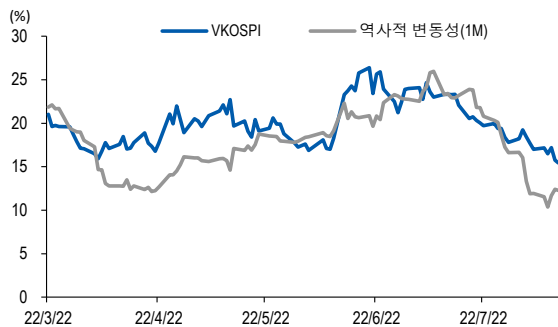
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	384,835	137.2	636,737	12.6%	지수옵션 전체	891,758	285.9	1,667,099
Put	506,923	148.7	1,030,362	15.8%	PCR(금액기준)	1.08	VKOSPI	15.45%(-0.29%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	337.5(K+3)	2.23	0.03	41,726	9,922	1,808	12.6	Put	332.5(K+1)	5.99	-0.47	2,264	1,005	421	14.8
	335.0(K+2)	3.11	0.05	30,075	11,134	1,123	12.8		330.0(K+0)	4.77	-0.46	10,184	14,300	4,000	14.9
	332.5(K+1)	4.22	0.09	10,644	9,400	4,051	13.0		327.5(K-1)	3.82	-0.37	7,307	4,359	1,023	15.2
	330.0(K+0)	5.51	0.13	9,507	11,491	1,111	13.2		325.0(K-2)	3.02	-0.30	19,522	10,193	1,690	15.6
	327.5(K-1)	7.03	0.17	2,391	2,262	-5	13.4		322.5(K-3)	2.36	-0.27	26,314	9,062	5,132	15.9

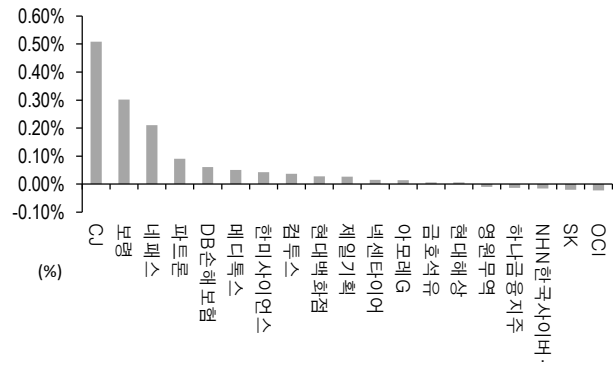
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	2,950,397	1,855.1	3,526,561	298,064	30,147	68,653	-102,087	16.2	29.9	-48.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	6,670	1.06	0.7	108.9	4,704	1,887	0.01%	244	-1,039	795	630	165
호텔신라	72,300	-0.82	10.1	84.8	11,858	6,373	-0.26%	2,089	451	-2,539	-2,783	244
삼성전자	60,100	0.50	510.6	78.9	1,018,030	15,787	-0.18%	10,929	-32,727	21,633	13,398	150
LG 전자	102,000	0.99	86.0	74.1	34,401	2,617	-0.07%	-1,262	1,595	-355	808	-1,663
일진머티리얼즈	77,300	2.52	14.5	68.9	49,147	4,190	-0.03%	-68	3,820	-3,749	-2,930	-819
현대차	197,000	1.55	78.2	63.9	45,580	6,201	-0.03%	1,404	3,770	-5,374	-1,943	-3,861
메리츠증권	4,920	0.20	1.0	61.5	21,102	-2,020	-0.41%	-1,976	-1,152	3,128	3,128	0
BGF	4,250	-0.93	0.1	54.7	1,176	199	-0.58%	191	42	-233	-233	0
한국조선해양	93,600	-0.43	6.4	45.9	5,162	652	-0.16%	-1,174	341	833	111	722
SK 하이닉스	93,500	0.43	79.4	44.5	194,249	14,879	-0.05%	-1,714	4,934	-3,086	-3,267	210

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터