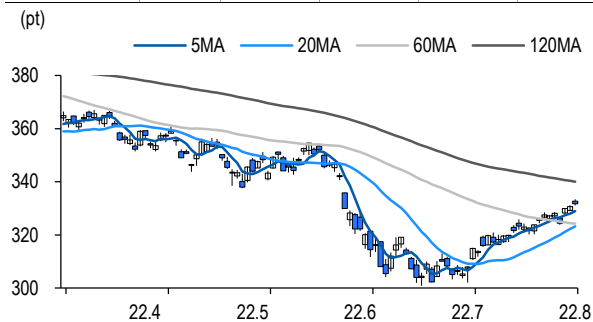


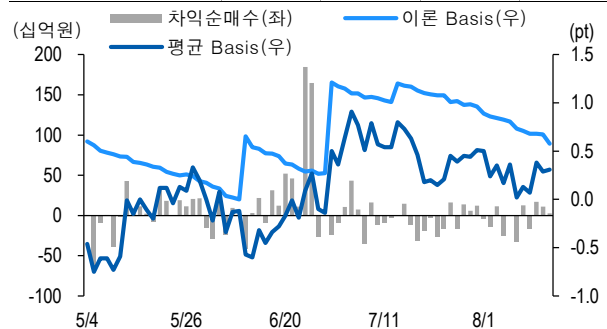
선물옵션시장 지표

2022.8.17

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	331.78	0.34	1.11	6,133.3	-
선물 9월물	332.05	0.41	1.35	13,698.0	295,326
선물 12월물	333.20	0.42	1.40	111.5	20,183
9월물(mini)	332.06	0.41	1.36	1,035.3	35,128
10월물(mini)	331.88	0.41	1.34	1.8	3,808



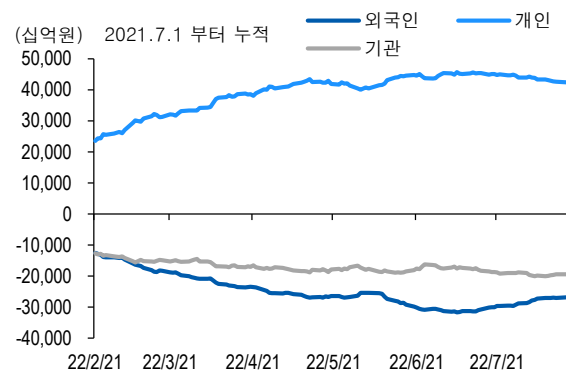
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.58	0.31	0.27	-0.08%
베이스(mini)	0.58	0.31	0.28	-0.08%
제1스프레드(SP)	1.58	1.18	1.15	-0.12%
합성선물 베이스(ATM)	0.58	0.25	0.25	-0.10%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	56.7	76.7	133.4	3.3	-115.1	-48.3	-23.7	0.0	-1.2	-24.2
개인	-53.4	-95.4	-148.7	0.0	0.4	12.3	0.9	-0.7	-2.3	94.7
기관	-24.9	40.5	15.7	-0.4	-22.2	37.9	18.4	0.8	3.6	-69.4
금융투자	42.2	90.7	132.8	-0.4	-0.5	223.3	19.9	0.7	3.6	-43.7
투신	-25.0	-3.4	-28.3	0.0	-14.1	-163.8	-1.7	0.1	0.0	9.0
은행+보험+기타금융	-14.0	-56.3	-70.3	0.0	-3.5	3.1	0.2	0.0	0.0	0.7
연기금+국가지자체	-9.5	0.5	-9.0	0.0	-1.7	-24.7	0.0	0.0	0.0	-35.3
기타법인	21.6	-21.9	-0.3	0.0	-1.5	-1.8	4.4	-0.1	-0.2	-1.2

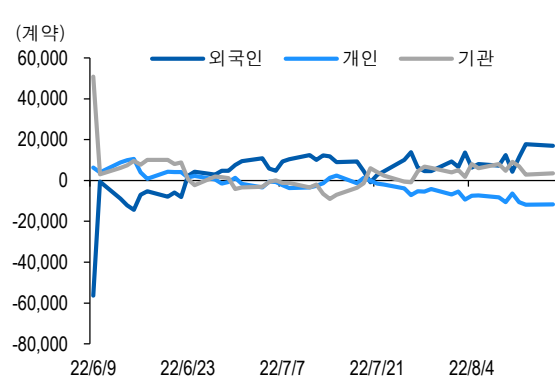
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



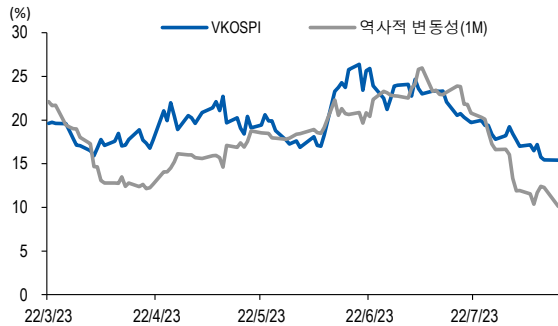
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	450,130	139.4	677,208	12.8%	지수옵션 전체	967,984	271.6	1,784,135
Put	517,854	132.2	1,106,927	15.5%	PCR(금액기준)	0.95	VKOSPI	15.42%(-0.03%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	337.5(K+3)	2.30	0.07	35,791	11,637	1,715	12.8	Put	332.5(K+1)	4.93	-1.06	7,849	2,652	1,647	14.4
	335.0(K+2)	3.26	0.15	21,404	11,601	467	13.0		330.0(K+0)	3.89	-0.88	16,212	15,705	1,405	14.8
	332.5(K+1)	4.46	0.24	7,982	10,470	1,070	13.3		327.5(K-1)	3.00	-0.82	15,784	5,654	1,295	15.0
	330.0(K+0)	5.92	0.41	4,633	11,686	195	13.7		325.0(K-2)	2.31	-0.71	29,338	11,665	1,472	15.4
	327.5(K-1)	7.55	0.52	2,503	2,295	33	14.0		322.5(K-3)	1.78	-0.58	34,109	11,006	1,944	15.9

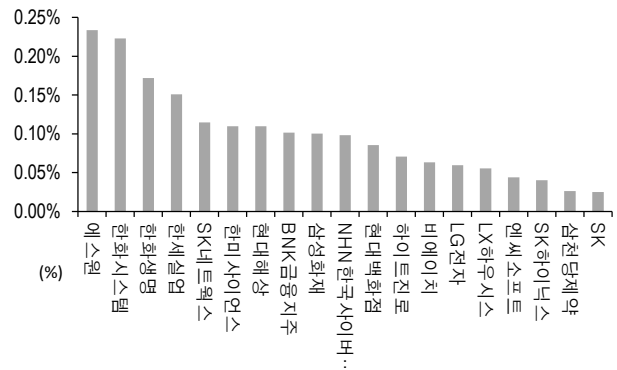
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,054,275	2,112.1	3,622,615	96,054	-63,440	119,496	-55,698	-24.2	94.7	-69.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,900	1.33	676.7	78.7	1,024,968	6,938	-0.06%	-6,806	59,652	-53,087	-23,321	-36,600
넥센타이어	6,700	0.45	0.9	74.7	4,087	-617	-0.13%	1,005	210	-1,215	-1,215	0
SK 하이닉스	96,700	3.42	286.5	72.3	176,676	-17,573	0.04%	-10,111	30,542	-20,258	-25,461	-3,150
LG 화학	662,000	-0.60	62.3	65.9	8,881	252	-0.08%	-317	442	-124	-18	-106
한국조선해양	92,900	-0.75	7.7	65.2	5,620	458	-0.11%	-431	383	48	536	-489
현대차	198,000	0.51	59.6	59.9	46,354	774	-0.10%	-2,243	1,855	495	-369	864
일진머티리얼즈	77,800	0.65	12.6	52.2	50,718	1,571	-0.02%	302	1,168	-1,458	-854	-602
LG 전자	102,500	0.49	43.8	49.5	38,304	3,903	0.06%	2,439	-130	-2,309	-1,104	-1,205
호텔신라	72,900	0.83	4.4	49.1	12,358	500	-0.14%	262	486	-748	-672	-76
삼성전기	138,000	0.36	24.9	47.6	29,795	825	0.02%	788	712	-1,391	-321	-1,152

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터