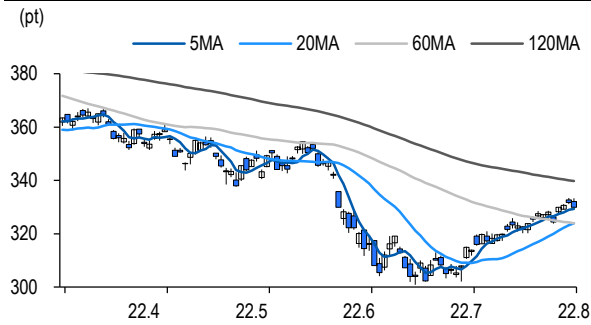


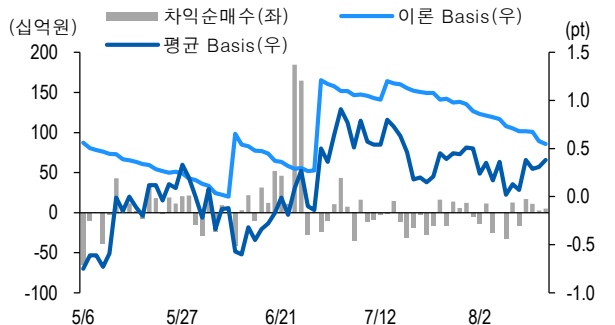
선물옵션시장 지표

2022.8.18

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	329.91	-0.56	-1.87	5,238.0	-
선물 9월물	329.80	-0.68	-2.25	14,668.9	298,960
선물 12월물	331.30	-0.57	-1.90	95.5	20,147
9월물(mini)	329.82	-0.67	-2.24	1,088.9	36,773
10월물(mini)	330.20	-0.51	-1.68	10.9	4,412

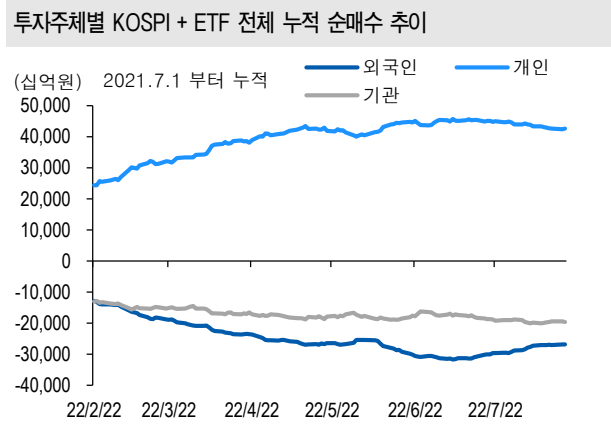


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.55	0.38	-0.11	-0.05%
베이스스(mini)	0.55	0.38	-0.09	-0.05%
제1스프레드(SP)	1.57	1.19	1.20	-0.12%
합성선물 베이스스(ATM)	0.55	0.02	0.02	-0.16%

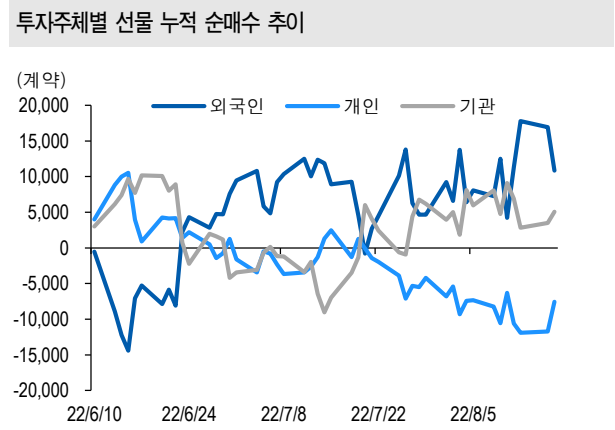


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	56.7	-8.1	48.6	5.7	43.0	-455.4	-46.3	-5.3	1.0	19.4
개인	153.4	-4.3	149.1	0.0	-7.0	307.2	36.7	2.9	-2.5	-48.8
기관	-200.4	24.5	-175.9	-0.6	-23.2	125.4	3.9	2.5	1.6	29.9
금융투자	67.6	33.3	100.9	1.0	-5.8	73.9	5.0	2.7	1.6	22.2
투신	-61.7	4.6	-57.1	0.0	-9.7	31.3	-0.9	-0.2	0.0	-2.6
은행+보험+기타금융	-38.9	-17.1	-56.0	0.0	-10.4	8.0	-0.2	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-95.6	-2.3	-97.9	-3.2	4.0	12.2	0.0	0.0	0.0	10.3
기타법인	-9.6	-12.1	-21.7	0.0	-1.3	22.8	5.7	-0.1	-0.1	-0.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

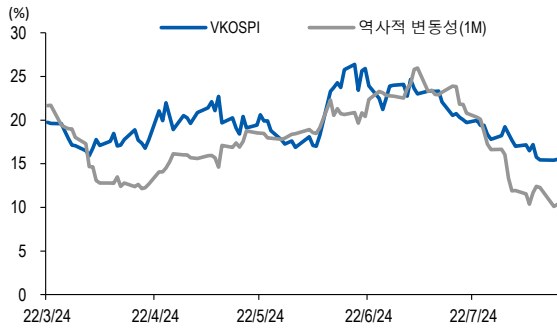
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정		
Call	436,991	129.2	702,509	12.5%	지수옵션 전체	870,766	261.0	1,843,648		
Put	433,775	131.8	1,141,139	15.4%	PCR(금액기준)	1.02	VKOSPI	15.51%(+0.09%p)		

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	340.0(K+3)	1.04	-0.50	69,573	28,319	3,917	12.5	Put	335.0(K+1)	7.50	1.29	2,958	3,488	318	14.8
	337.5(K+2)	1.64	-0.66	45,978	13,746	2,109	12.7		332.5(K+0)	5.96	1.03	5,753	2,885	233	14.8
	335.0(K+1)	2.39	-0.87	29,212	13,818	2,217	12.8		330.0(K-1)	4.69	0.80	16,358	16,063	358	14.9
	332.5(K+0)	3.39	-1.07	15,818	11,502	1,032	13.0		327.5(K-2)	3.65	0.65	17,423	6,203	549	15.2
	330.0(K-1)	4.55	-1.37	7,667	13,362	1,676	13.0		325.0(K-3)	2.80	0.49	32,930	13,394	1,729	15.5

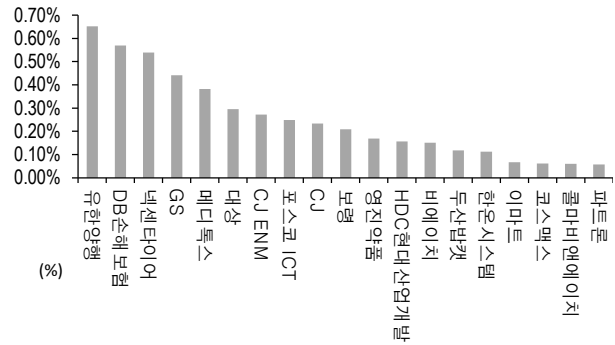
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,513,666	1,887.0	3,642,141	19,526	12,879	-47,583	36,203	19.4	-48.8	29.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,600	-0.49	509.3	93.0	1,023,357	-1,611	-0.10%	-1,391	-23,322	24,963	27,339	-2,376
삼성전기	137,500	-0.36	28.5	74.6	29,757	-38	-0.09%	-365	247	118	-583	656
현대차	189,500	-4.29	181.0	67.4	43,365	-2,989	-0.02%	4,890	-6,419	1,518	4,225	-1,857
SK 하이닉스	97,200	0.52	110.9	65.1	173,492	-3,184	-0.11%	-2,989	-8,022	11,068	6,682	5,131
LG 전자	102,500	0.00	90.1	56.8	31,529	-6,775	-0.36%	-129	-6,368	6,497	207	6,160
SK 이노베이션	210,000	2.94	69.3	55.1	19,672	4,951	0.03%	1,110	-425	-604	-3,482	-2,083
호텔신라	72,600	-0.41	3.9	55.0	12,508	150	-0.17%	-328	-44	402	390	12
LG 화학	660,000	-0.30	55.2	53.4	8,897	16	-0.05%	527	-287	-239	-189	-78
LG 이노텍	349,500	-0.43	18.0	52.1	5,839	-414	-0.08%	-365	-74	409	179	230
신한지주	36,100	0.98	15.0	49.6	60,593	2,532	-0.10%	-2,420	-3,691	6,080	2,634	3,446

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터