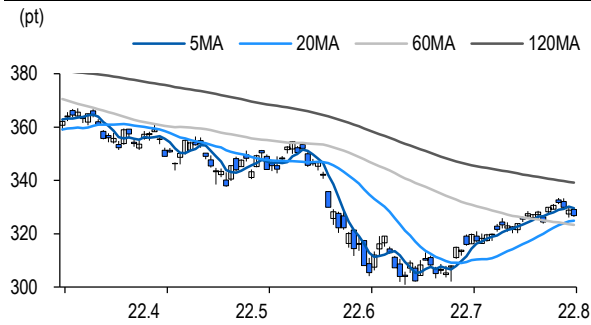


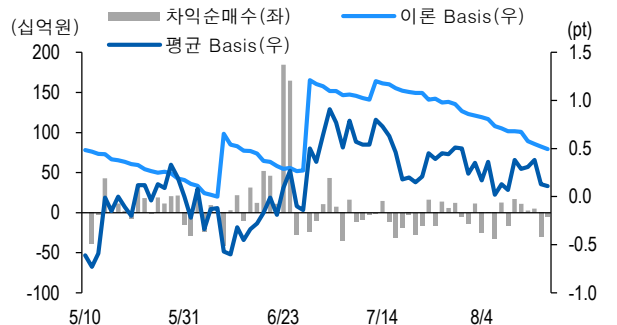
선물옵션시장 지표

2022.8.22

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	326.79	-0.61	-2.01	4,775.0	-
선물 9월물	326.80	-0.47	-1.55	14,018.5	295,417
선물 12월물	328.05	-0.56	-1.85	56.4	20,388
9월물(mini)	326.78	-0.48	-1.62	1,003.9	41,318
10월물(mini)	326.84	-0.53	-1.74	4.9	4,951

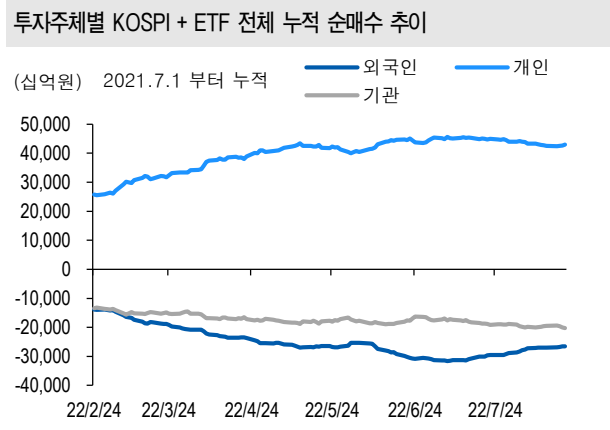


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.49	0.11	0.01	-0.12%
베이스(mini)	0.49	0.11	-0.01	-0.12%
제1스프레드(SP)	1.54	1.22	1.20	-0.10%
합성선물 베이스(ATM)	0.49	0.01	0.01	-0.15%

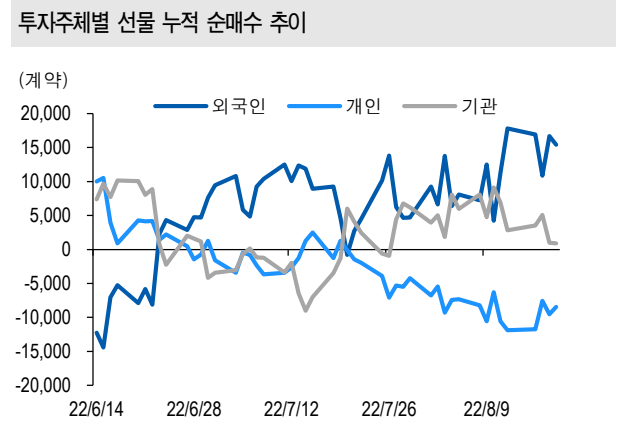


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-89.9	48.0	-42.0	1.3	-33.5	-97.9	-5.7	1.7	-2.5	-31.8
개인	271.3	-0.6	270.8	0.0	-4.5	84.4	3.4	-0.3	-0.7	-5.6
기관	-200.8	-49.9	-250.7	-5.8	-27.4	-7.0	1.3	-1.3	3.2	37.9
금융투자	7.1	-46.3	-39.2	-4.1	-3.8	54.9	2.1	-1.0	2.7	-58.2
투신	-21.8	-1.0	-22.7	0.0	-5.5	-62.0	-0.9	-0.3	0.0	-13.8
은행+보험+기타금융	-14.1	3.2	-10.9	0.0	-3.7	-17.8	0.0	0.0	0.5	0.7
연기금+국가자재	-180.2	2.9	-177.3	-1.7	-13.6	18.0	0.0	0.0	0.0	109.3
기타법인	19.4	2.5	21.9	0.0	-0.6	20.6	1.0	-0.1	0.0	-0.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

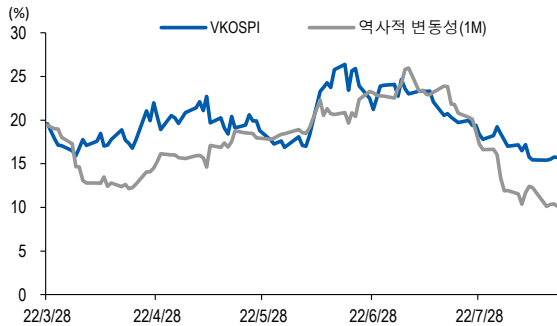
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	448,191	122.8	735,548	12.7%	지수옵션 전체	889,733	274.5	1,954,699			
Put	441,542	151.7	1,219,151	15.5%	PCR(금액기준)	1.23	VKOSPI	15.73%(-0.04%p)			

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	337.5(K+3)	0.79	-0.43	66,534	16,941	1,744	12.5	Put	332.5(K+1)	7.68	0.90	2,121	3,457	207	14.7
	335.0(K+2)	1.31	-0.56	60,249	16,913	748	12.8		330.0(K+0)	6.11	0.73	4,485	15,772	88	14.8
	332.5(K+1)	2.00	-0.70	39,943	12,374	778	12.9		327.5(K-1)	4.75	0.53	9,381	7,295	142	14.9
	330.0(K+0)	2.91	-0.88	24,666	16,764	1,475	13.1		325.0(K-2)	3.67	0.40	23,198	13,774	-114	15.2
	327.5(K-1)	4.12	-1.00	7,707	4,492	858	13.5		322.5(K-3)	2.81	0.31	32,837	10,988	-366	15.6

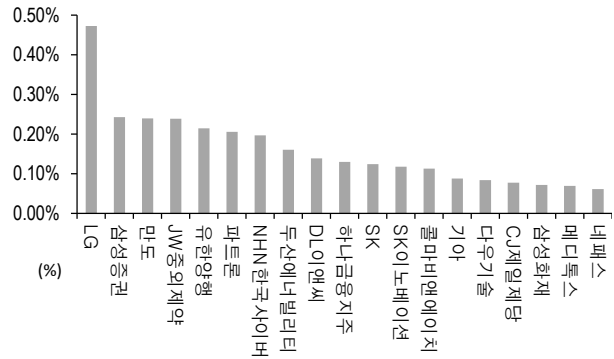
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	2,323,159	1,588.6	3,771,082	3,906	-51,958	-34,704	87,032	-31.8	-5.6	37.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	60,900	-0.49	366.1	87.1	1,027,879	-48,949	-0.11%	-6,039	3,145	3,454	-15,998	42,796
LG 전자	100,500	-1.95	43.5	76.5	25,840	-1,080	-0.06%	1,787	-3,185	1,398	-1,052	2,323
현대차	189,500	1.07	108.1	74.3	44,333	-1,568	-0.02%	-997	535	462	-5,513	5,696
SK 하이닉스	96,200	0.31	130.1	71.4	169,947	-7,554	0.00%	-2,886	407	2,587	-9,189	9,815
삼성전기	137,000	-1.08	21.2	68.4	29,284	-360	-0.04%	-1,350	382	930	-1,169	2,099
LG 화학	640,000	-2.14	50.3	62.3	8,225	-815	-0.10%	-286	-409	738	447	291
호텔신라	71,700	-0.83	3.7	59.3	12,465	-577	-0.10%	-1,757	68	1,689	1,208	481
한국조선해양	91,700	-0.43	6.6	54.4	5,830	351	-0.15%	-554	161	373	-47	417
넷마블	66,900	-0.30	3.1	48.2	11,004	475	-0.27%	-830	683	147	92	60
현대건설	46,050	-1.07	9.0	47.9	34,093	60	0.05%	-682	825	-143	-1,160	1,038

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터