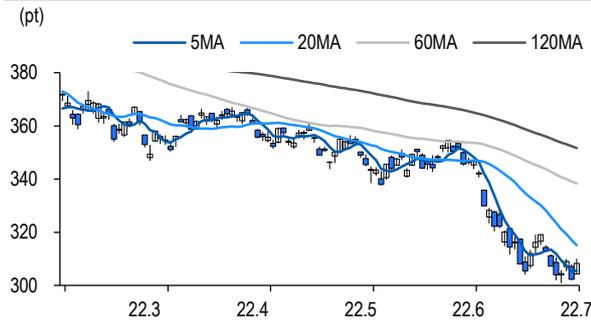


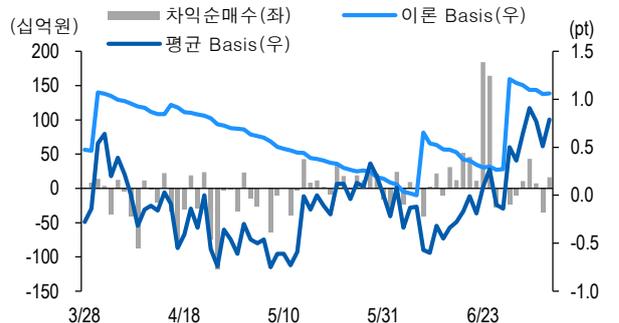
선물옵션시장 지표

2022.7.8

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	308.31	1.99	6.03	6,107.9	-
선물 9월물	308.95	1.86	5.65	25,176.6	313,267
선물 12월물	309.65	1.86	5.65	42.3	18,759
7월물(mini)	308.32	1.82	5.52	2,098.7	115,466
8월물(mini)	308.44	1.90	5.76	12.7	15,018

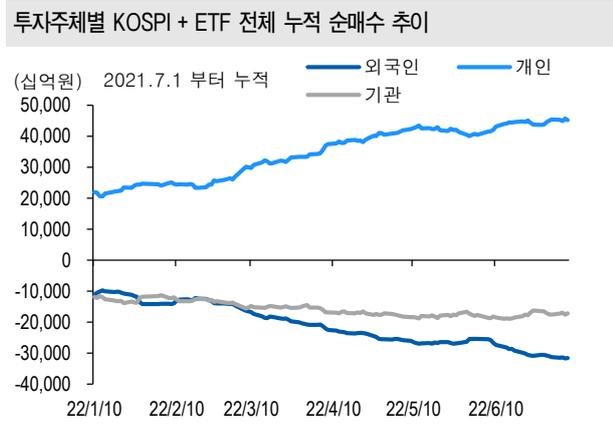


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	1.06	0.79	0.64	-0.09%
베이스스(mini)	0.12	0.14	0.01	0.01%
제1스프레드(SP)	0.87	0.75	0.75	-0.04%
합성선물 베이스스(ATM)	0.12	0.08	0.08	-0.01%

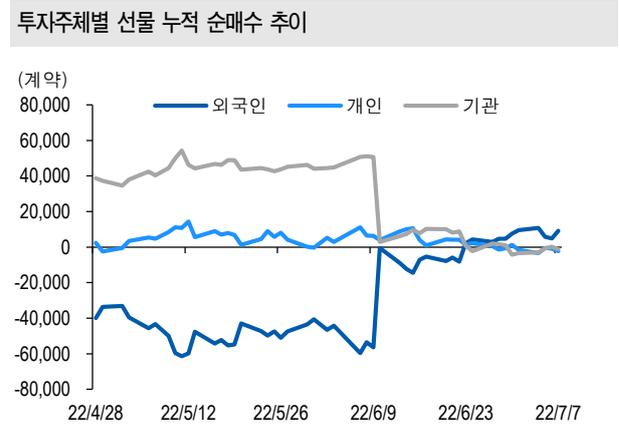


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	142.3	-75.2	67.0	-0.1	145.1	339.9	-1.7	-0.2	5.4	4.1
개인	-473.0	29.6	-443.5	0.0	2.6	-76.1	-42.4	-0.9	-2.2	5.5
기관	316.5	49.0	365.5	16.1	-17.9	-145.2	46.4	1.5	-1.0	-12.9
금융투자	216.9	44.4	261.2	-0.6	-8.0	-637.1	46.5	1.1	-0.5	-17.2
투신	20.0	4.0	24.0	0.0	-16.5	527.3	0.0	0.0	-0.4	13.5
은행+보험+기타금융	6.9	0.1	7.0	0.0	-3.6	-19.4	-0.2	0.4	0.0	0.1
연기금+국가지자체	71.7	-2.4	69.3	15.2	12.0	-16.2	0.0	0.0	0.0	-9.4
기타법인	14.3	-3.3	11.0	0.0	0.4	-118.6	-2.2	-0.4	-2.2	3.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,522,501	396.9	1,376,583	20.2%	지수옵션 전체	2,790,598	653.2	3,048,643
Put	1,268,097	256.3	1,672,060	22.8%	PCR(금액기준)	0.65	VKOSPI	23.60%(-1.07%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	310.0(K+3)	3.00	1.67	123,780	18,513	289	20.4	Put	305.0(K+1)	2.39	-2.89	49,699	18,943	3,815	21.4
	307.5(K+2)	4.23	2.14	50,169	12,346	1,285	20.6		302.5(K+0)	1.66	-2.34	69,177	22,051	5,733	21.8
	305.0(K+1)	5.78	2.69	15,869	9,075	588	21.0		300.0(K-1)	1.14	-1.83	118,745	35,592	6,150	22.4
	302.5(K+0)	7.55	3.23	8,652	5,083	492	21.5		297.5(K-2)	0.75	-1.44	109,630	25,254	2,969	22.9
	300.0(K-1)	9.51	3.74	5,586	2,899	826	21.9		295.0(K-3)	0.48	-1.09	132,045	25,584	1,829	23.3

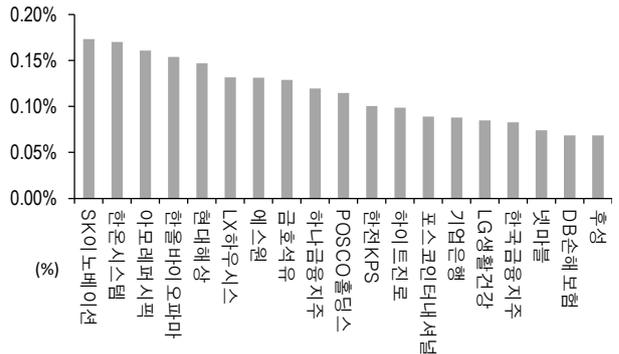
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,910,698	2,500.5	4,351,668	-37,619	25,982	15,865	-47,926	4.1	5.5	-12.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전기	133,500	1.91	85.3	100.6	29,544	-2,026	-0.10%	-1,488	-1,065	2,553	1,655	80
삼성전자	58,200	2.83	1,007.1	82.5	1,219,330	-34,771	0.06%	-11,101	27,933	-21,377	-28,318	4,325
현대차	174,500	1.16	74.6	79.8	44,117	343	0.01%	1,348	-295	-1,053	-497	-556
아모레퍼시픽	134,500	2.28	16.9	76.0	10,497	-852	0.16%	264	-323	59	-1,624	-559
넥센타이어	5,400	1.89	0.2	71.0	6,410	-1,471	-0.24%	800	-452	-348	-348	0
호텔신라	69,100	0.73	4.9	67.4	11,341	-494	-0.09%	-283	-249	532	447	85
LG 전자	96,000	3.11	66.0	63.7	32,594	-1,850	-0.05%	-1,690	1,931	-241	510	-2,245
LG 화학	524,000	4.17	68.9	63.7	6,979	-178	-0.03%	-99	-314	413	406	51
JW 중외제약	24,100	2.12	0.9	62.8	2,524	113	-0.07%	528	-29	-499	-499	0
일진머티리얼즈	70,200	1.01	14.9	62.0	51,807	-1,236	0.00%	-1,782	1,959	-178	-321	135

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터