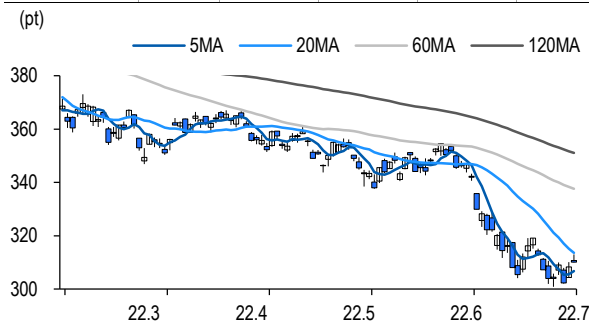


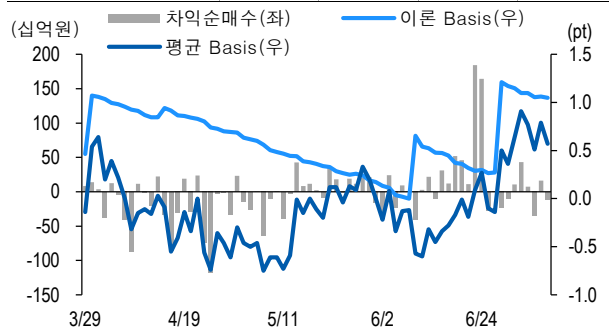
## 선물옵션시장 지표

2022.7.11

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	310.15	0.60	1.84	5,416.8	-
선물 9월물	310.80	0.60	1.85	24,720.6	306,769
선물 12월물	311.25	0.52	1.60	44.4	18,746
7월물(mini)	310.26	0.63	1.94	2,221.2	113,350
8월물(mini)	310.06	0.53	1.62	15.5	15,301



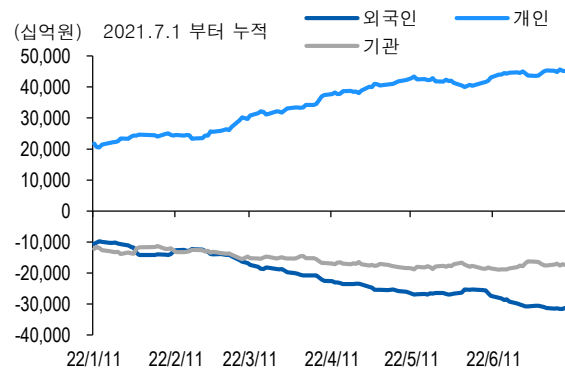
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.05	0.57	0.65	-0.15%
베이스(mini)	0.10	0.02	0.11	-0.03%
제1스프레드(SP)	0.87	0.75	0.75	-0.04%
합성선물 베이스(ATM)	0.10	-0.10	-0.10	-0.07%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	247.2	10.1	257.4	-4.7	119.2	-4.3	92.2	-0.4	8.3	-10.2
개인	-89.4	-9.9	-99.3	0.0	-4.9	-87.0	-16.3	3.1	-2.2	-26.7
기관	-171.8	-0.2	-172.1	-6.4	-13.7	73.7	-78.2	-2.5	-5.1	38.3
금융투자	-168.9	28.6	-140.3	-3.3	-2.1	355.0	-78.9	-3.0	-4.4	19.7
투신	3.0	-33.0	-30.0	0.0	-7.9	-313.3	0.2	0.1	-0.4	-12.3
은행+보험+기타금융	19.8	10.7	30.5	0.0	-4.4	29.0	0.4	0.5	-0.3	-0.9
연기금+국가지자체	-30.5	-2.2	-32.6	-3.0	-1.3	3.1	0.0	0.0	0.0	31.9
기타법인	14.0	-0.1	13.9	0.0	-0.7	17.6	2.4	-0.2	-1.0	-1.4

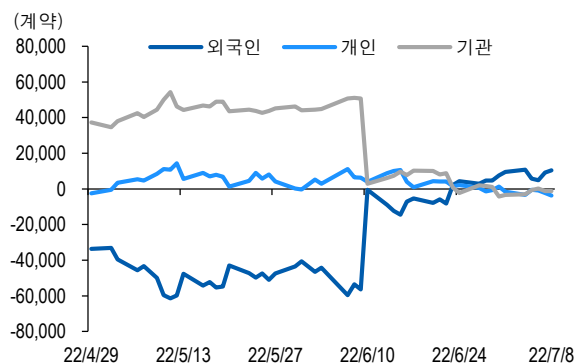
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

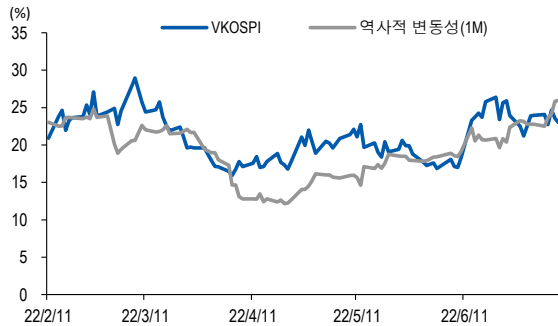
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,011,916	459.8	1,435,339	18.4%	지수옵션 전체	4,014,359	848.6	3,168,176
Put	2,002,443	388.9	1,732,837	21.2%	PCR(금액기준)	0.85	VKOSPI	23.00%(-0.60%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	315.0(K+3)	1.33	0.12	206,247	25,198	-451	18.2	Put	310.0(K+1)	3.33	-1.29	74,770	24,601	3,785	20.2
	312.5(K+2)	2.22	0.27	92,098	15,627	777	18.7		307.5(K+0)	2.34	-1.02	132,667	17,188	3,414	20.8
	310.0(K+1)	3.41	0.41	43,236	20,099	1,586	19.1		305.0(K-1)	1.52	-0.87	218,855	19,267	324	20.9
	307.5(K+0)	4.89	0.66	12,211	12,720	374	19.5		302.5(K-2)	0.95	-0.71	244,139	26,591	4,540	21.1
	305.0(K-1)	6.59	0.81	4,722	8,842	-233	19.5		300.0(K-3)	0.60	-0.54	315,239	41,478	5,886	21.7

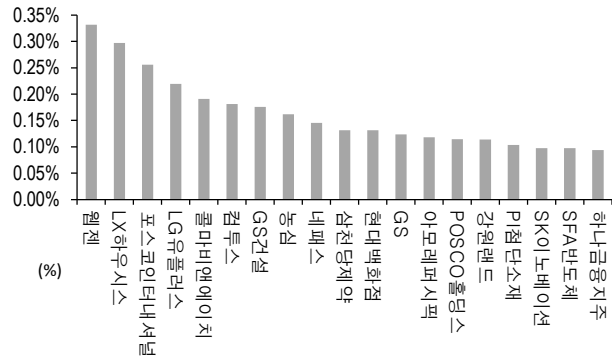
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	3,491,678	2,457.7	4,303,432	-48,236	2,795	-19,602	18,429	-10.2	-26.7	38.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	58,600	0.69	763.2	85.4	1,117,288	-102,042	0.00%	-27,019	-15,031	41,910	-4,498	48,311
넥센타이어	5,470	1.30	0.2	84.4	5,254	-1,156	-0.13%	526	-721	195	195	0
에코프로비엠	118,700	2.95	35.9	81.3	19,338	-2,848	-0.39%	-22	1,577	-1,323	-1,729	0
현대차	178,000	2.01	119.4	81.3	45,642	1,525	-0.07%	714	187	-901	-1,512	610
삼성전기	134,500	0.75	61.0	75.4	29,449	-95	-0.19%	-589	-817	1,406	386	1,224
호텔신라	69,700	0.87	6.0	70.4	10,457	-884	0.01%	-456	784	-363	-284	-212
SK 하이닉스	94,800	0.85	187.5	69.8	176,144	-23,899	-0.10%	911	-26,468	25,566	27,681	-301
현대건설	39,500	0.51	12.9	65.8	15,787	-2,048	-0.04%	-3,404	3,496	-92	-911	74
기아	76,900	1.59	49.5	59.7	48,921	-2,565	0.04%	-1,063	4,944	-3,879	-1,311	-2,262
LG 화학	541,000	3.24	88.0	59.1	7,028	49	0.04%	150	-466	321	461	-140

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터