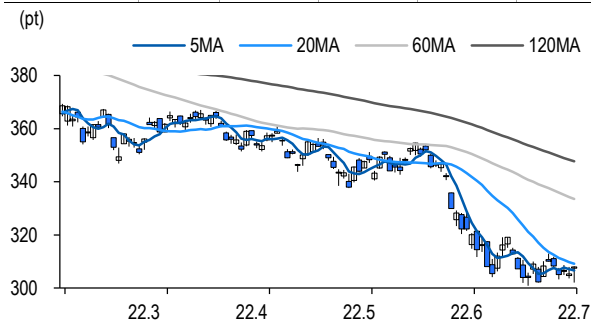


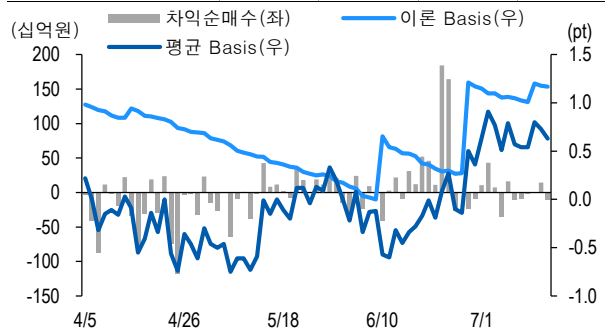
선물옵션시장 지표

2022.7.18

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	307.91	0.84	2.56	5,422.4	-
선물 9월물	308.00	0.46	1.40	29,552.2	291,739
선물 12월물	308.90	0.47	1.45	37.7	19,604
8월물(mini)	307.78	0.51	1.56	2,510.0	45,606
9월물(mini)	308.08	0.48	1.58	16.2	7,636



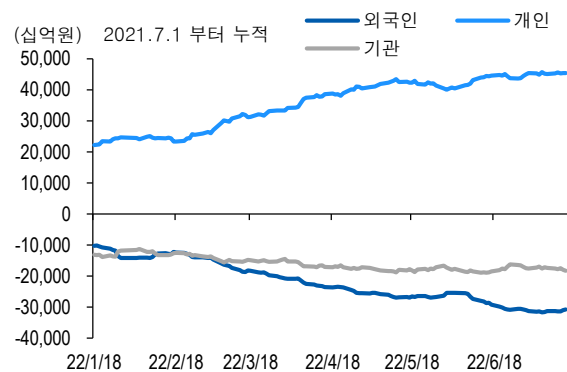
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.17	0.63	0.09	-0.17%
베이스(mini)	0.56	0.29	-0.13	-0.09%
제1스프레드(SP)	1.27	0.87	0.95	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.56	-0.07	-0.07	-0.20%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	263.3	-4.3	259.0	-3.7	101.8	-205.2	24.9	5.0	1.4	-1.4
개인	-20.8	6.3	-14.5	0.0	0.6	45.9	-9.7	-2.9	-3.8	17.5
기관	-262.6	-6.6	-269.3	-7.7	-12.9	174.3	-12.6	-1.9	3.3	-18.8
금융투자	-292.5	-18.2	-310.7	1.3	1.3	-62.2	-12.6	-1.3	5.7	25.0
투신	-15.0	5.9	-9.1	0.0	-14.5	259.3	0.0	-0.6	-0.3	-6.2
은행+보험+기타금융	5.0	3.9	9.0	0.0	-0.9	-32.6	0.0	0.0	-2.1	0.1
연기금+국가지자체	19.1	6.3	25.4	-9.1	3.4	9.9	0.0	0.0	0.0	-37.7
기타법인	20.2	4.7	24.9	0.0	-2.6	-15.0	-2.6	-0.2	-0.9	2.7

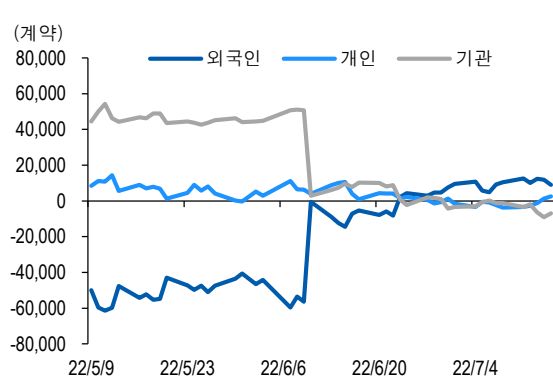
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



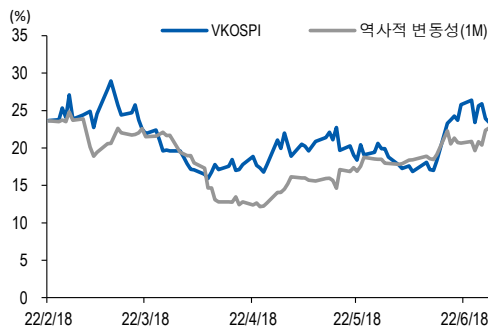
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	788,337	251.5	691,816	19.2%	지수옵션 전체	1,633,071	550.9	1,702,574
Put	844,734	299.4	1,010,758	22.2%	PCR(금액기준)	1.19	VKOSPI	22.08%(-1.24%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	312.5(K+3)	4.71	0.38	12,046	2,887	1,040	19.0	Put	307.5(K+1)	6.85	-1.06	7,265	3,682	1,172	21.6
	310.0(K+2)	5.84	0.41	9,172	6,337	619	19.3		305.0(K+0)	5.74	-1.06	11,051	10,080	1,201	21.7
	307.5(K+1)	7.12	0.53	10,605	3,567	1,114	19.5		302.5(K-1)	4.85	-0.92	8,297	4,043	1,517	22.1
	305.0(K+0)	8.58	0.56	7,517	3,644	425	19.8		300.0(K-2)	4.03	-0.92	12,305	18,019	266	22.4
	302.5(K-1)	10.30	0.60	3,669	2,076	1,433	20.5		297.5(K-3)	3.36	-0.83	10,582	3,771	817	22.8

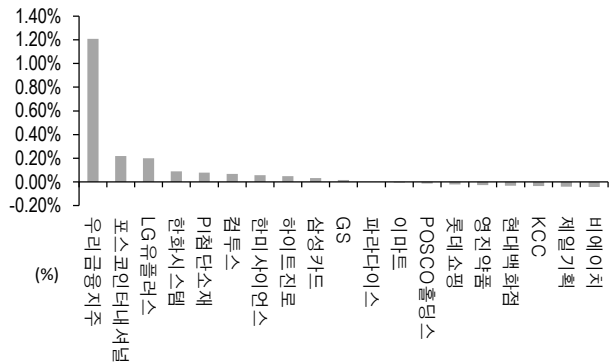
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,477,237	2,232.0	3,504,993	239,629	-33,188	33,708	-4,529	-1.4	17.5	-18.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	5,570	-0.71	1.7	252.3	3,919	40	-0.23%	1,416	-796	-620	-620	0
현대차	183,500	0.27	117.5	84.6	40,132	2,551	-0.12%	1,142	2,389	-3,482	3,493	-6,435
대한항공	24,350	-2.21	20.2	83.7	49,038	10,208	-0.15%	-15,776	4,068	11,008	7,521	3,487
다우기술	17,650	-1.40	0.6	77.7	1,042	117	-0.36%	169	17	-186	-186	0
현대제철	31,400	-1.10	8.3	77.5	11,240	-3,589	-0.17%	3,389	-7,170	3,781	2,224	1,557
LG 이노텍	340,000	0.15	70.0	72.3	8,484	2,775	-0.14%	330	1,714	-2,165	-107	-2,058
호텔신라	67,800	-0.29	9.4	67.0	9,595	1,680	-0.09%	1,593	-38	-1,255	-309	-946
기아	79,300	0.25	56.5	64.5	47,484	2,548	-0.12%	2,581	-3,723	1,133	831	302
삼성전자	60,000	3.81	699.4	63.8	1,109,614	7,816	-0.07%	-25,852	33,943	-9,345	-37,633	28,102
삼성전기	139,000	4.91	66.6	61.1	25,693	4,572	-0.05%	5,224	2,567	-7,792	-3,939	-4,446

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터