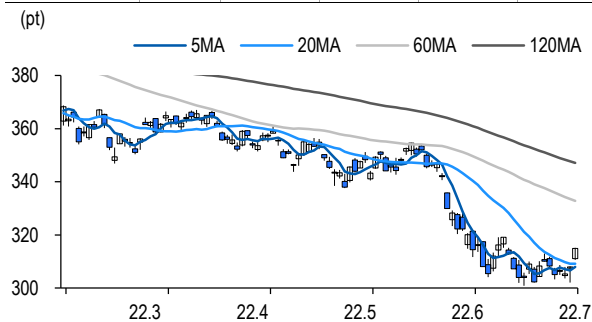


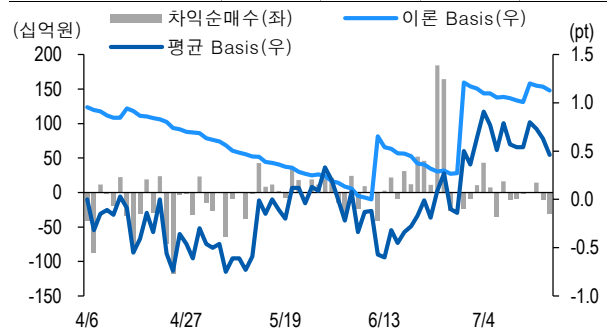
선물옵션시장 지표

2022.7.19

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	314.87	2.26	6.96	5,306.1	-
선물 9월물	316.00	2.60	8.00	21,112.6	292,300
선물 12월물	316.50	2.46	7.60	36.3	19,661
8월물(mini)	315.62	2.55	7.84	1,601.1	48,025
9월물(mini)	315.58	2.46	7.50	6.0	7,617



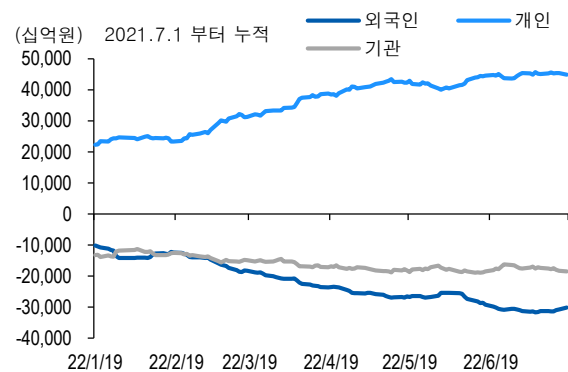
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.13	0.46	1.13	-0.21%
베이스(mini)	0.50	0.18	0.75	-0.10%
제1스프레드(SP)	1.32	0.89	0.90	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.50	0.38	0.38	-0.04%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	627.3	10.8	638.1	-5.5	322.7	-121.1	144.8	1.9	5.5	2.2
개인	-421.6	-19.8	-441.4	0.0	-0.6	-235.5	-59.1	1.2	-5.2	29.1
기관	-200.0	-18.5	-218.5	-25.9	-5.5	360.7	-83.3	-2.6	0.2	-31.2
금융투자	-266.8	-78.6	-345.4	-4.0	-3.7	-17.1	-84.8	-3.6	2.7	2.4
투신	18.0	-1.6	16.5	0.0	-3.5	371.4	1.4	0.0	-0.1	-0.1
은행+보험+기타금융	20.9	62.1	83.0	0.0	6.1	-14.6	0.0	1.0	-2.4	-0.2
연기금+국가지자체	-2.1	-1.7	-3.9	-21.9	-2.1	20.9	0.0	0.0	0.0	-33.3
기타법인	-5.7	27.6	21.8	0.0	0.7	-4.0	-2.3	-0.5	-0.5	0.0

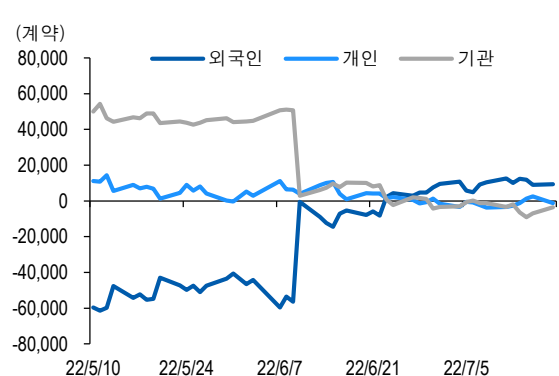
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

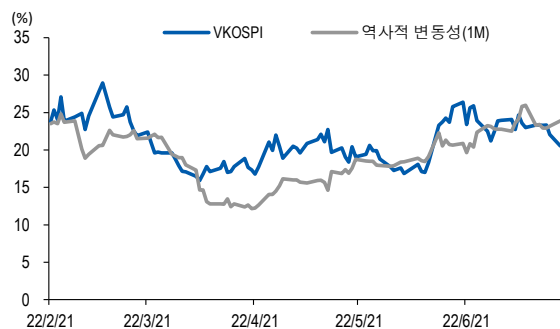


선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향											(계약, 십억원)					
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정		
Call	694,819		245.1		742,737		19.5%		지수옵션 전체		1,511,354		430.8		1,858,973	
Put	816,535		185.7		1,116,236		20.7%		PCR(금액기준)		0.76		VKOSPI		20.53%(−1.55%p)	
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	315.0(K+3)	6.60	2.87	13,905	12,256	331	19.5	Put	310.0(K+1)	4.05	−3.94	7,279	10,128	969	19.6	
	312.5(K+2)	8.06	3.35	6,647	3,097	210	19.9		307.5(K+0)	3.30	−3.55	9,314	4,332	650	20.0	
	310.0(K+1)	9.67	3.83	6,699	6,690	353	20.4		305.0(K−1)	2.70	−3.04	15,093	11,213	1,133	20.5	
	307.5(K+0)	11.05	3.93	2,136	3,357	−210	19.6		302.5(K−2)	2.16	−2.69	21,119	5,001	958	20.9	
	305.0(K−1)	12.90	4.32	1,606	3,775	131	19.9		300.0(K−3)	1.71	−2.32	30,895	20,271	2,252	21.2	

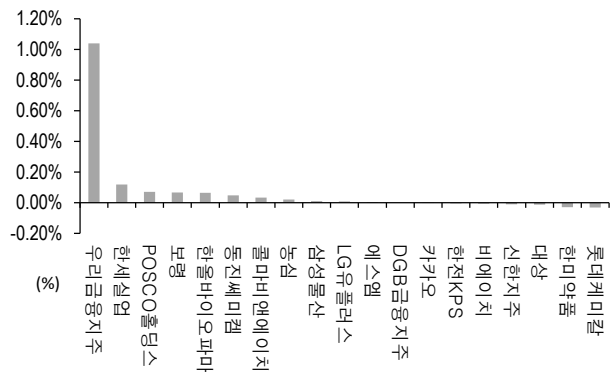
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	3,332,216	2,287.2	3,654,465	149,472	74,773	41,718	-118,090	2.2	29.1	-31.2		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균과리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	5,860	5.21	1.5	196.3	5,792	1,873	-0.07%	342	907	-1,249	-1,249	0
삼성 SDI	545,000	-1.09	68.3	80.7	15,426	-845	-0.09%	210	-459	242	-139	381
엔씨소프트	368,500	1.10	15.1	69.5	7,508	317	-0.04%	599	0	-494	-121	-448
현대차	185,500	1.09	88.9	68.8	40,747	615	-0.10%	-2,079	235	1,793	1,349	630
삼성전기	140,000	0.72	58.9	65.4	24,762	-931	-0.11%	-2,740	-311	3,050	96	939
삼성전자	62,000	3.33	802.2	63.6	1,142,986	33,372	-0.13%	-22,521	22,049	253	-20,112	7,567
LG 이노텍	345,000	1.47	46.9	62.8	8,618	134	-0.12%	-402	306	96	29	65
SK 하이닉스	101,000	2.23	288.0	62.2	187,981	16,723	-0.46%	-5,205	-34,531	39,718	48,452	-6,240
카카오	73,000	4.14	73.2	60.3	71,606	20,266	0.00%	4,597	19,145	-23,745	-10,392	-14,515
LG 화학	516,000	0.19	49.0	59.6	8,112	506	-0.07%	839	325	-1,160	-193	-953

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터