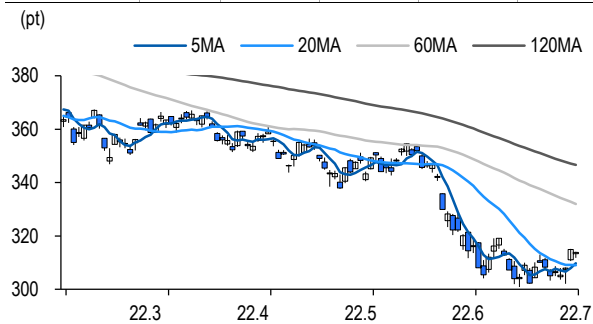


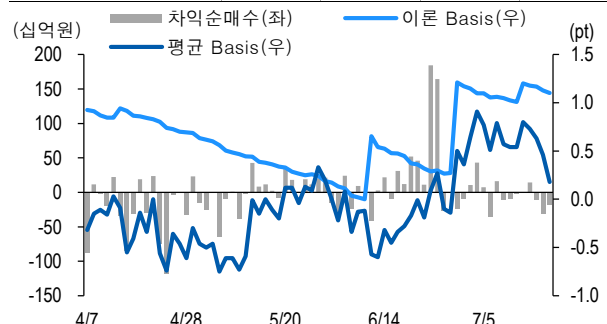
선물옵션시장 지표

2022.7.20

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.90	-0.31	-0.97	4,535.9	-
선물 9월물	313.70	-0.73	-2.30	18,885.6	293,851
선물 12월물	314.70	-0.57	-1.80	30.4	19,587
8월물(mini)	313.46	-0.68	-2.16	1,321.2	53,406
9월물(mini)	313.90	-0.66	-1.68	9.4	7,519



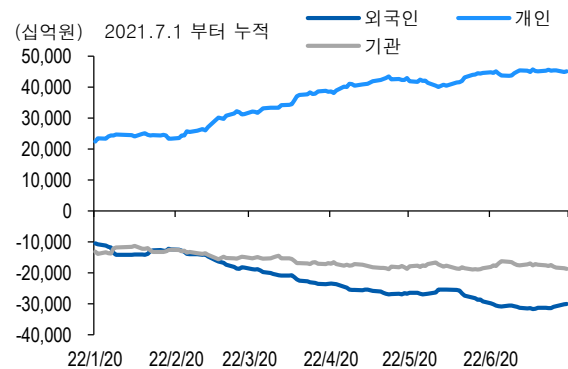
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.10	0.18	-0.20	-0.29%
베이스(mini)	0.48	-0.03	-0.44	-0.16%
제1스프레드(SP)	1.31	0.95	0.95	-0.11%
합성선물 베이스(ATM)	0.48	-0.35	-0.35	-0.26%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	38.3	9.9	48.2	-10.5	-3.7	-435.8	70.2	0.4	4.6	-8.3
개인	91.6	34.0	125.6	0.0	-2.0	170.4	29.9	1.2	-4.1	9.2
기관	-144.1	-48.1	-192.2	-8.2	-6.0	264.7	-97.5	-1.6	0.6	-1.1
금융투자	-192.0	-64.5	-256.5	-2.0	-3.9	536.1	-97.5	-2.1	4.7	-5.7
투신	12.4	-5.4	7.0	0.0	-6.7	-262.9	-0.1	0.0	0.0	24.7
은행+보험+기타금융	17.7	14.0	31.7	0.0	7.8	-15.5	0.0	0.5	-4.1	0.5
연기금+국가자재	36.1	11.5	47.6	-6.3	-3.4	7.0	0.0	0.0	0.0	-20.5
기타법인	14.2	4.2	18.4	0.0	-0.4	0.7	-2.6	-0.1	-1.1	0.1

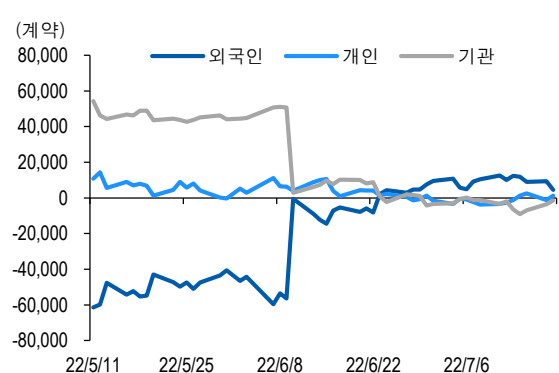
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



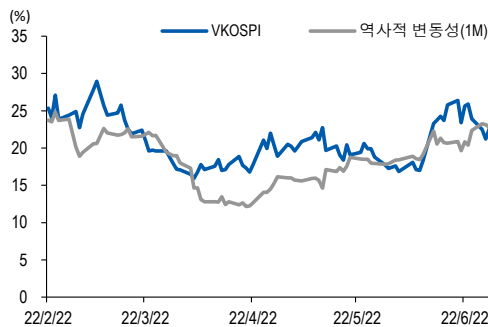
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향										(계약, 십억원)					
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정	
Call	493,284		162.2		771,183		17.3%		지수옵션 전체	1,135,239		347.1		1,953,386	
Put	641,955		184.8		1,182,203		21.0%			PCR(금액기준)	1.14		VKOSPI		20.74%(+0.21%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	2.47	-0.66	42,089	15,658	2,259	17.3	Put	317.5(K+1)	8.23	0.77	2,437	1,984	403	20.4
	320.0(K+2)	3.29	-0.81	22,638	15,790	1,771	17.4		315.0(K+0)	6.90	0.93	9,764	5,898	2,616	20.5
	317.5(K+1)	4.29	-0.94	9,368	9,877	832	17.7		312.5(K-1)	5.74	0.76	5,624	8,465	629	20.8
	315.0(K+0)	5.45	-1.15	9,037	12,857	601	17.9		310.0(K-2)	4.72	0.67	8,148	11,440	1,312	21.0
	312.5(K-1)	6.77	-1.29	4,762	3,911	814	18.0		307.5(K-3)	3.87	0.57	7,455	4,949	617	21.3

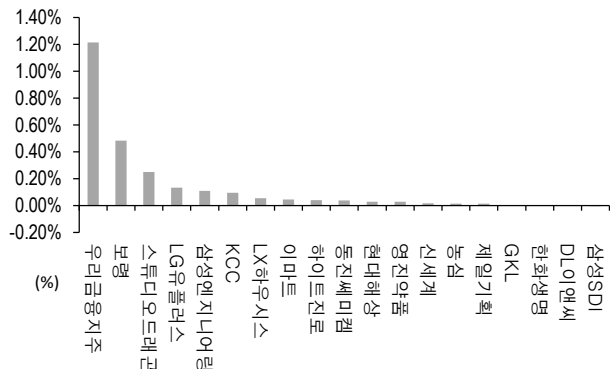
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,998,458	2,020.5	3,715,399	60,934	-32,159	28,935	2,310	-8.3	9.2	-1.1		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균피리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	61,100	-1.45	880.7	95.6	1,172,937	29,951	-0.06%	6,486	-696	-6,227	4,881	-46,264
삼성전기	140,000	0.00	35.7	94.2	25,701	939	-0.09%	-363	3,283	-2,921	-574	-2,294
넥센타이어	5,930	1.19	1.0	88.6	8,124	2,332	-0.12%	2,097	1,056	-3,153	-3,070	0
현대건설	39,000	0.26	10.5	72.2	13,932	-1,898	-0.12%	-4,387	2,174	2,213	1,652	561
엔씨소프트	367,000	-0.41	9.5	70.1	7,669	161	-0.07%	96	29	-142	-142	0
삼성 SDI	547,000	0.37	48.5	65.9	15,777	351	-0.01%	171	195	-339	53	-557
SK 하이닉스	100,500	-0.50	171.4	63.8	198,410	10,429	-0.22%	919	-1,436	520	9,973	-8,163
카카오	73,000	0.00	41.1	60.1	68,965	-2,641	-0.08%	-1,929	-293	2,222	-4,102	6,855
현대차	188,500	1.62	91.6	60.0	42,822	2,075	-0.17%	1,501	866	-2,358	-1,154	-785
GS 건설	28,950	0.35	6.3	59.9	21,099	-877	-0.13%	-1,518	1,554	-136	-1,991	1,855

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터