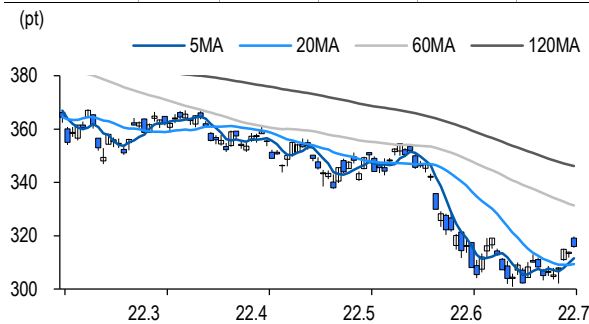


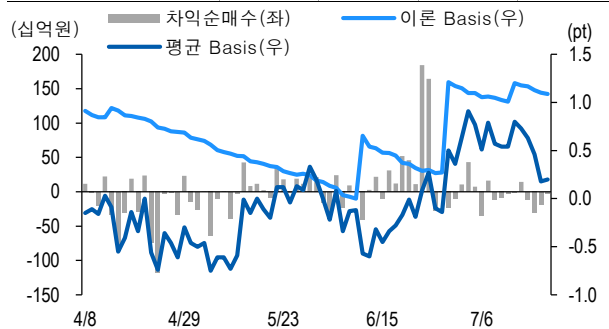
## 선물옵션시장 지표

2022.7.21

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.02	0.68	2.12	5,670.1	-
선물 9월물	316.50	0.89	2.80	21,935.8	297,616
선물 12월물	317.50	0.89	2.80	39.2	19,713
8월물(mini)	316.30	0.91	2.84	1,466.3	55,720
9월물(mini)	316.48	0.89	2.58	3.4	7,526



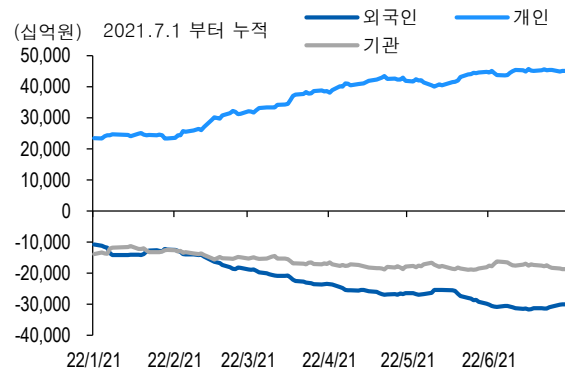
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	1.09	0.20	0.48	-0.28%
베이스스(mini)	0.46	0.03	0.28	-0.14%
제1스프레드(SP)	1.32	0.99	1.00	-0.11%
합성선물 베이스스(ATM)	0.46	0.22	0.22	-0.08%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-41.1	17.2	-23.9	-5.4	35.2	-456.0	26.8	-2.4	3.0	-12.7
개인	64.5	-77.5	-12.9	0.0	-2.7	-104.1	-3.4	2.4	-4.1	17.9
기관	-58.6	44.1	-14.6	2.5	-31.2	604.7	-22.6	-0.1	1.3	-15.7
금융투자	-57.1	-42.1	-99.3	-10.1	-0.2	311.0	-22.9	-0.4	1.4	-28.6
투신	7.8	1.5	9.3	0.0	-7.5	264.5	0.3	0.0	0.0	6.0
은행+보험+기타금융	-6.8	-0.8	-7.7	0.0	-4.8	44.8	0.0	0.4	0.0	1.1
연기금+국가자재	-23.2	63.5	40.3	14.3	-14.0	-15.6	0.0	0.0	0.0	5.7
기타법인	35.2	16.2	51.4	0.0	-0.2	-44.7	-0.7	0.0	-0.3	10.6

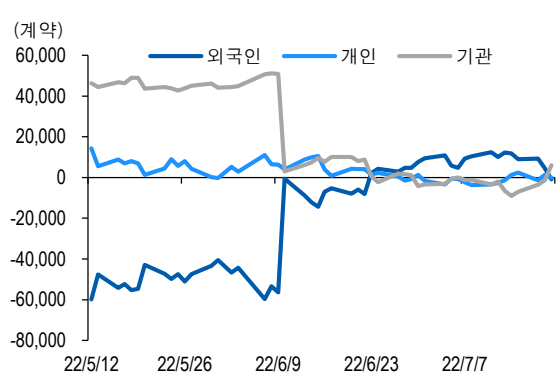
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

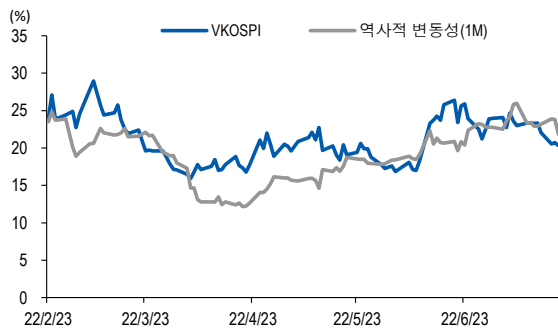
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	736,627	239.0	820,318	17.8%	지수옵션 전체	1,481,162	409.6	2,048,859
Put	744,535	170.6	1,228,541	20.2%	PCR(금액기준)	0.71	VKOSPI	20.31%(-0.43%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	3.18	0.71	19,270	15,421	-237	17.8	Put	317.5(K+1)	6.55	-1.68	4,299	3,146	1,162	19.1
	320.0(K+2)	4.16	0.87	17,942	16,070	280	18.0		315.0(K+0)	5.41	-1.49	13,328	8,500	2,602	19.4
	317.5(K+1)	5.34	1.05	6,663	10,058	181	18.4		312.5(K-1)	4.40	-1.34	7,232	8,812	347	19.7
	315.0(K+0)	6.65	1.20	8,524	13,382	525	18.6		310.0(K-2)	3.56	-1.16	13,761	11,758	318	20.1
	312.5(K-1)	8.19	1.42	2,563	3,742	-169	19.0		307.5(K-3)	2.88	-0.99	25,775	5,942	993	20.5

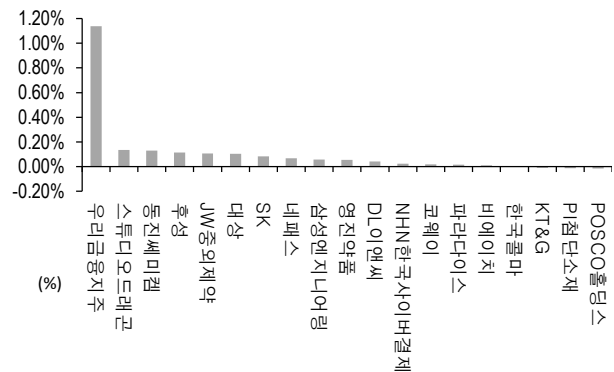
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	3,086,316	2,133.1	3,799,524	84,125	-28,198	42,207	-31,350	-12.7	17.9	-15.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	6,110	3.04	0.8	82.5	6,498	-1,626	-0.31%	-1,787	-1,517	3,304	3,221	0
삼성전기	140,000	0.00	50.2	79.5	27,950	2,249	-0.07%	-2,743	4,609	-1,866	-598	-1,268
SK 하이닉스	102,000	1.49	318.5	78.4	181,801	-16,609	-0.30%	1,476	-20,456	18,920	9,985	10,590
삼성전자	60,800	-0.49	698.5	68.2	1,218,441	45,504	-0.02%	-370	4,788	-21,520	-14,349	-8,735
카카오	73,400	0.55	80.4	61.6	75,209	6,244	-0.04%	-4,444	9,273	-4,829	-5,126	-1,456
현대건설	38,900	-0.26	7.3	54.7	12,875	-1,057	-0.14%	-2,015	468	1,547	251	1,296
현대차	189,000	0.27	95.2	50.9	44,477	1,655	-0.09%	-3,092	1,747	1,184	1,107	76
LG 화학	538,000	3.07	60.8	50.5	8,604	869	-0.08%	-688	868	-192	-125	-51
GS 건설	28,950	0.00	7.6	47.5	20,563	-536	-0.08%	-2,348	3,343	-995	-1,502	507
NAVER	246,500	0.82	74.1	47.0	30,814	1,465	-0.09%	1,086	1,647	-2,733	-513	-2,932

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터