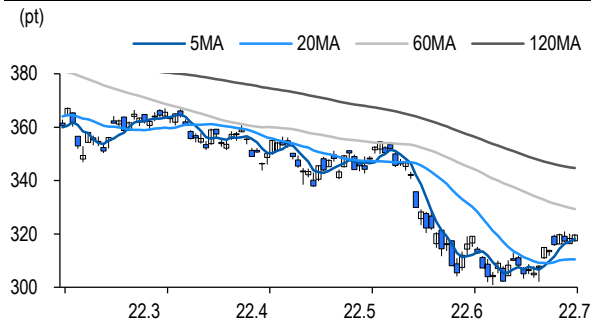


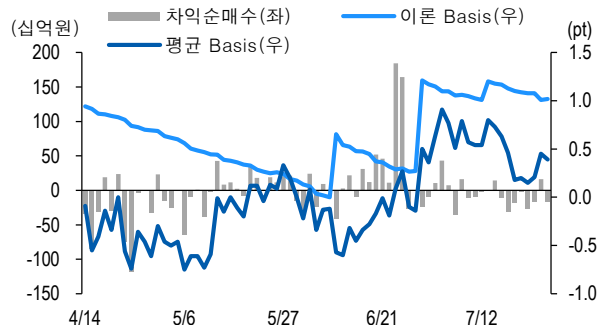
선물옵션시장 지표

2022.7.27

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	319.61	0.40	1.27	3,865.6	-
선물 9월물	320.50	0.44	1.40	16,624.7	292,943
선물 12월물	321.50	0.44	1.40	30.1	19,829
8월물(mini)	320.22	0.46	1.46	1,180.7	64,080
9월물(mini)	320.40	0.41	1.46	9.6	7,309

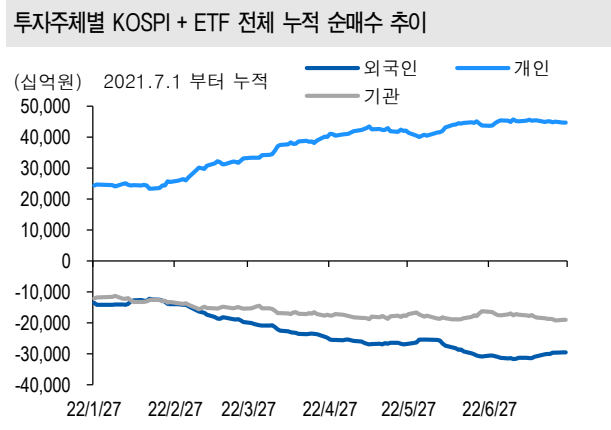


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.98	0.39	0.89	-0.18%
베이스(mini)	0.34	0.11	0.61	-0.07%
제1스프레드(SP)	1.34	1.02	1.00	-0.10%
합성선물 베이스(ATM)	0.34	0.62	0.62	0.09%

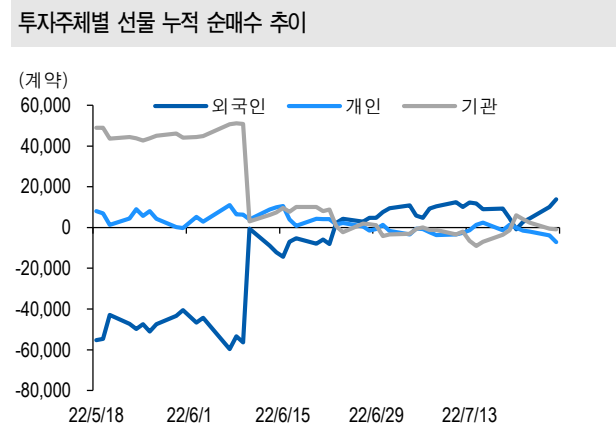


투자주체별 매매 동향 (십억원)											
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	2.2	12.3	14.5	1.1	55.4	288.0	5.4	1.4	-0.8	4.5	
개인	-47.6	41.6	-6.0	0.0	-0.8	-250.1	-8.2	0.4	-0.2	-10.3	
기관	45.9	-57.3	-11.4	-1.6	-36.0	-30.9	7.4	-1.8	1.6	7.0	
금융투자	55.0	-60.7	-5.8	0.0	1.0	-46.1	7.1	-1.1	1.6	-13.3	
투신	-2.5	4.5	2.0	0.0	-6.6	-26.6	0.1	0.0	0.0	11.9	
은행+보험+기타금융	8.4	-3.7	4.7	0.0	-9.9	31.7	0.1	-0.7	0.0	-2.3	
연기금+국가지자체	-10.2	4.7	-5.5	-1.6	-15.1	10.1	0.0	0.0	0.0	10.7	
기타법인	-0.6	3.5	2.9	0.0	-1.0	-7.0	-4.6	-0.1	-0.7	-1.2	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



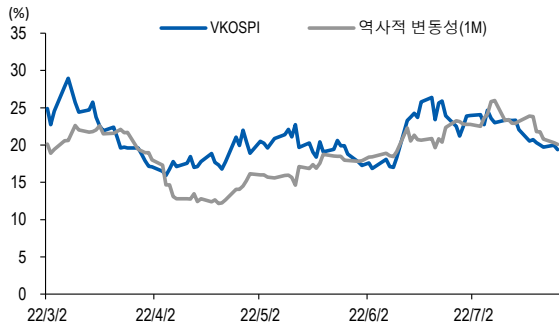
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	526,735	167.2	886,267	17.4%	지수옵션 전체	1,156,884	332.2	2,238,810
Put	630,149	165.0	1,352,543	18.8%	PCR(금액기준)	0.99	VKOSPI	19.38%(-0.59%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	325.0(K+3)	2.71	0.25	48,455	25,724	-435	17.3	Put	320.0(K+1)	4.77	-0.96	5,168	6,982	699	17.3
	322.5(K+2)	3.77	0.37	19,677	16,843	732	17.8		317.5(K+0)	3.74	-0.87	11,685	6,355	568	17.8
	320.0(K+1)	5.03	0.48	14,977	16,756	-150	18.3		315.0(K-1)	2.88	-0.79	18,323	11,841	503	18.2
	317.5(K+0)	6.47	0.57	4,543	9,985	-297	18.7		312.5(K-2)	2.19	-0.66	20,366	11,197	360	18.7
	315.0(K-1)	8.14	0.69	4,179	13,294	-267	19.3		310.0(K-3)	1.66	-0.56	36,343	15,236	555	19.2

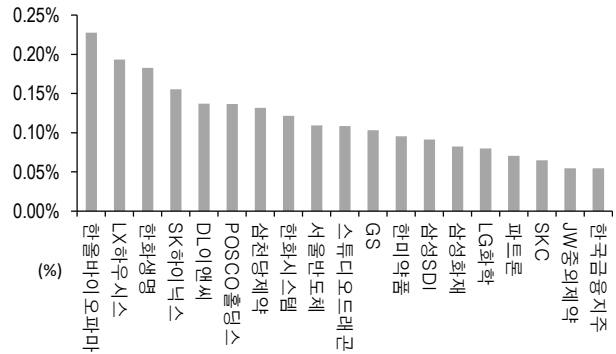
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,876,469	1,379.4	3,901,222	11,737	-23,591	-3,439	27,019	4.5	-10.3	7.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
BGF	4,170	-2.11	0.2	89.3	3,400	-375	-0.19%	-1,003	53	950	950	0
삼성전자	61,800	0.98	330.0	81.4	1,163,267	-23,143	-0.07%	94	-10,512	10,418	968	6,782
삼성전기	143,000	0.00	31.3	78.9	27,744	-1,251	-0.07%	-1,074	681	393	-333	716
현대차	196,000	-0.25	111.9	78.3	55,872	-439	-0.04%	706	880	-1,586	-1,758	1,108
SK 하이닉스	100,500	0.60	113.4	69.4	194,225	-965	0.16%	9,968	-6,671	-3,244	-5,781	-2,480
삼성 SDI	564,000	0.71	43.1	59.0	17,175	-137	0.09%	878	119	-994	-350	-549
대한항공	25,150	0.20	6.2	53.2	46,333	-1,374	0.05%	3,413	253	-3,666	-1,515	-2,151
LG 이노텍	350,500	1.74	21.8	52.2	8,077	73	-0.06%	652	-52	-600	-254	-346
현대위아	61,000	-0.49	6.2	52.2	5,596	1,347	-0.05%	-1,818	525	1,282	1,372	-90
KB 금융	47,650	-0.52	11.7	50.3	39,014	-573	-0.04%	-779	72	707	31	676

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터