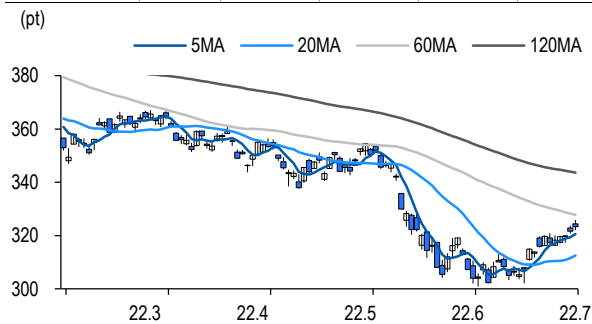


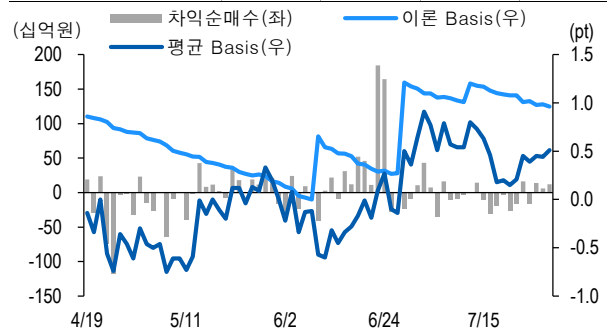
선물옵션시장 지표

2022.8.1

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	323.31	0.53	1.69	8,183.8	-
선물 9월물	323.45	0.20	0.65	19,649.7	300,159
선물 12월물	324.75	0.31	1.00	30.7	19,995
8월물(mini)	323.12	0.22	0.70	1,421.2	70,920
9월물(mini)	323.46	0.20	0.84	7.1	7,458



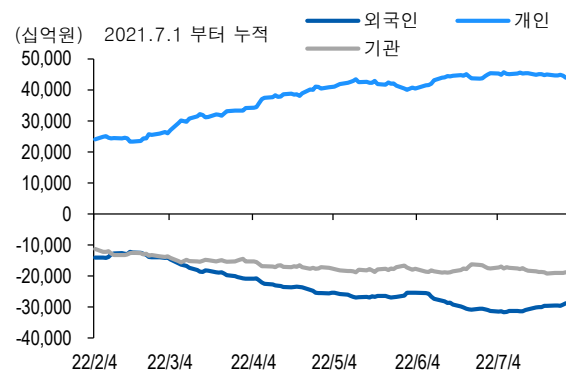
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.96	0.51	0.14	-0.14%
베이스스(mini)	0.28	0.23	-0.19	-0.02%
제1스프레드(SP)	1.46	1.04	1.00	-0.13%
합성선물 베이스스(ATM)	0.28	-0.23	-0.23	-0.16%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	337.2	28.6	365.8	4.1	233.8	15.8	-13.8	-1.1	3.4	35.8
개인	-492.4	-104.3	-596.7	0.0	1.4	84.7	21.0	1.6	-2.6	11.1
기관	147.2	67.2	214.4	8.1	-17.6	-39.8	-8.5	-0.4	0.1	-36.5
금융투자	311.9	17.0	328.9	1.6	1.4	58.6	-8.6	-1.0	0.3	-23.0
투신	-66.1	29.5	-36.6	0.0	-9.6	-90.5	0.1	0.0	0.0	-25.5
은행+보험+기타금융	-5.8	7.6	1.8	0.0	5.2	-2.9	0.0	0.6	-0.2	-8.1
연기금+국가지자체	-80.2	4.5	-75.7	6.5	-15.1	-4.9	0.0	0.0	0.0	20.1
기타법인	8.0	8.5	16.5	0.0	-4.9	-60.7	1.3	-0.1	-0.9	-10.4

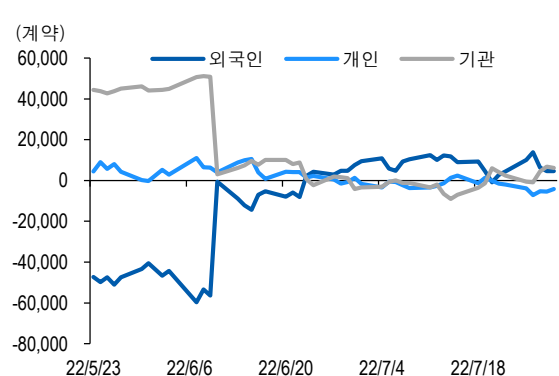
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



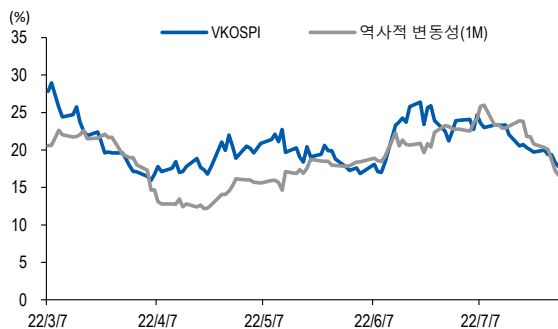
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	803,404	229.8	921,843	13.9%	지수옵션 전체	1,763,511	423.3	2,413,738
Put	960,107	193.5	1,491,895	17.5%	PCR(금액기준)	0.84	VKOSPI	17.79%(-0.57%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	1.24	-0.04	106,535	29,316	-508	13.9	Put	325.0(K+1)	4.88	-0.72	13,358	6,685	1,921	16.5
	327.5(K+2)	1.97	-0.05	64,715	19,858	-716	14.1		322.5(K+0)	3.68	-0.65	20,393	4,975	2,016	16.8
	325.0(K+1)	3.01	0.04	38,837	26,166	1,472	14.4		320.0(K-1)	2.68	-0.61	59,327	12,847	3,375	16.9
	322.5(K+0)	4.26	0.07	16,246	17,478	-27	14.5		317.5(K-2)	1.95	-0.50	57,924	11,281	2,369	17.4
	320.0(K-1)	5.80	0.15	7,680	16,649	-996	14.7		315.0(K-3)	1.39	-0.41	90,397	17,216	2,919	17.8

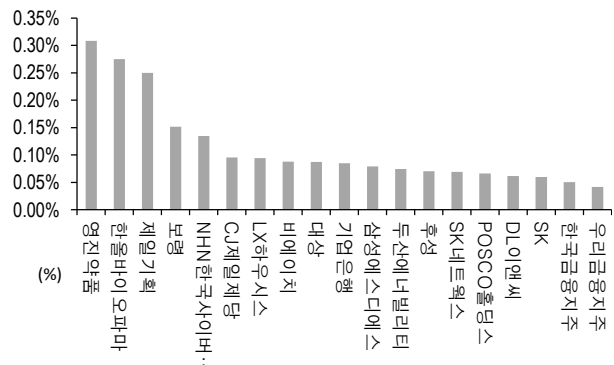
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,469,603	2,538.7	4,033,801	36,851	119,352	-15,916	-86,092	35.8	11.1	-36.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	6,230	0.32	1.7	248.4	7,387	-2,483	-0.26%	1,321	-2,781	1,460	1,460	0
현대차	196,500	0.51	137.6	83.4	53,250	-4,791	-0.08%	1,356	390	-1,746	1,417	1,996
삼성전자	61,600	-0.65	657.0	70.6	1,106,070	-43,564	-0.09%	34,817	-47,227	29,679	23,079	11,198
SK 하이닉스	97,600	-2.20	205.3	53.9	184,208	-6,636	-0.04%	10,554	9,069	-19,613	-16,479	3,052
삼성전기	143,000	-2.05	52.6	53.5	31,750	1,817	0.02%	-3,302	7,496	-4,214	-790	506
카카오	74,700	3.18	81.0	50.4	72,014	6,269	-0.05%	1,199	8,037	-9,236	-9,109	-1,891
SK 이노베이션	187,500	2.46	61.0	47.4	15,516	2,614	-0.01%	761	1,942	-2,628	-1,188	-1,621
일진머티리얼즈	73,400	0.14	6.9	47.2	47,265	709	-0.04%	-1,048	967	41	-147	188
삼성 SDI	569,000	-1.90	134.9	39.4	15,305	-3,290	0.01%	-1,489	91	1,354	1,354	2,141
LG 화학	602,000	0.33	72.4	39.3	12,266	-878	-0.06%	-1,066	-244	1,315	848	435

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터