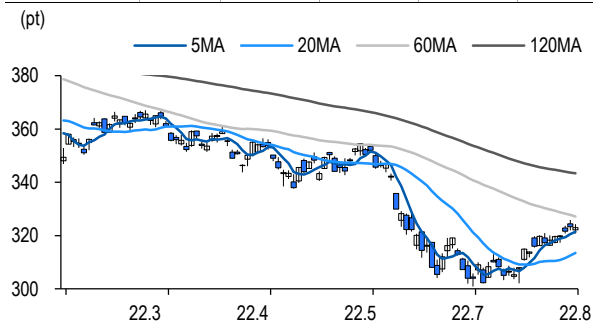


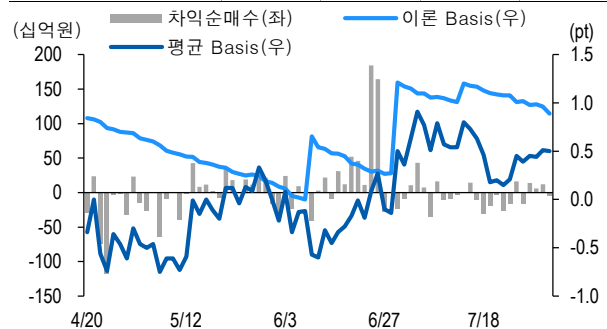
선물옵션시장 지표

2022.8.2

Market Data (십억원, 계약)					
	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	322.97	-0.11	-0.34	5,338.2	-
선물 9월물	323.90	0.14	0.45	18,319.9	303,054
선물 12월물	324.75	0.00	0.00	26.1	19,993
8월물(mini)	323.54	0.13	0.42	1,266.1	69,310
9월물(mini)	323.66	0.06	0.20	3.2	7,632



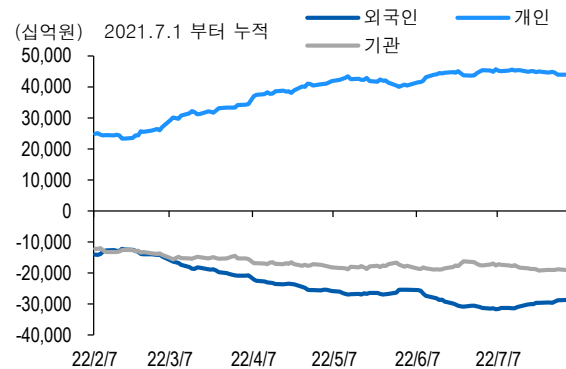
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.89	0.50	0.93	-0.12%
베이스스(mini)	0.21	0.17	0.57	-0.01%
제1스프레드(SP)	1.49	1.03	1.05	-0.14%
합성선물 베이스스(ATM)	0.21	0.50	0.50	0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	136.1	20.0	156.1	2.9	160.2	391.5	-22.4	0.4	-1.4	-10.2
개인	41.2	1.2	42.4	0.0	-1.2	-196.7	-11.1	-0.2	1.6	-3.9
기관	-175.4	-31.1	-206.6	-7.6	-34.4	-214.8	31.3	0.0	-0.1	14.1
금융투자	-79.6	-13.4	-93.1	-1.2	-3.2	-143.7	31.5	-0.1	0.0	9.8
투신	-25.7	7.1	-18.7	0.0	-28.0	-77.7	0.0	0.1	0.0	-0.7
은행+보험+기타금융	0.9	-3.3	-2.4	0.0	-5.9	-0.3	-0.2	0.0	0.0	-0.6
연기금+국가지자체	-35.8	-17.4	-53.2	-6.4	-1.6	7.0	0.0	0.0	0.0	5.6
기타법인	-1.9	9.9	8.0	0.0	-3.1	20.0	2.2	-0.2	-0.1	0.0

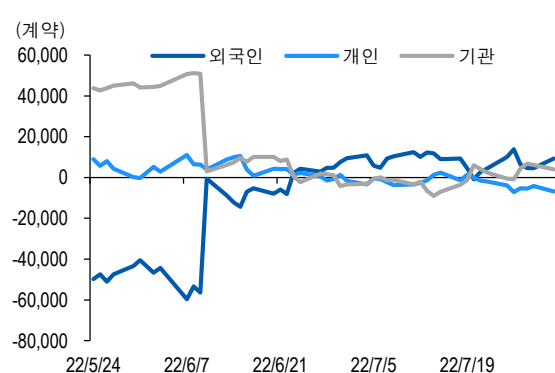
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



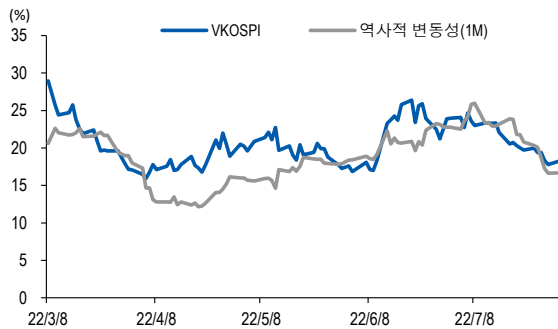
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	748,413	181.3	915,209	15.8%	지수옵션 전체	1,540,649	356.0	2,443,700
Put	792,236	174.7	1,528,491	17.6%	PCR(금액기준)	0.96	VKOSPI	18.22%(+0.43%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	1.15	-0.09	129,268	28,210	-1,106	15.7	Put	325.0(K+1)	4.41	-0.47	7,542	7,888	1,203	15.4
	327.5(K+2)	1.87	-0.10	73,911	19,338	-520	16.0		322.5(K+0)	3.26	-0.42	22,548	7,491	2,516	16.2
	325.0(K+1)	2.88	-0.13	51,095	24,913	-1,253	16.5		320.0(K-1)	2.37	-0.31	41,862	13,783	936	16.9
	322.5(K+0)	4.23	-0.03	14,956	17,189	-289	17.2		317.5(K-2)	1.66	-0.29	57,549	11,585	304	17.5
	320.0(K-1)	5.84	0.04	7,128	16,677	28	18.1		315.0(K-3)	1.12	-0.27	88,485	19,227	2,011	17.8

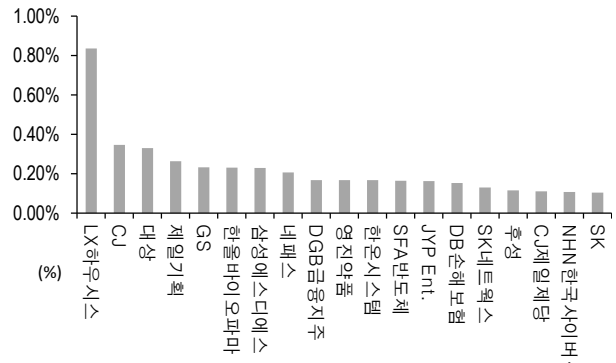
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,778,550	1,974.5	4,020,808	-12,993	-25,448	-21,884	47,497	-10.2	-3.9	14.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	6,190	-0.64	1.0	193.5	7,961	574	-0.27%	-2,792	20	2,772	2,772	0
삼성전자	61,400	-0.32	737.1	91.9	1,102,842	-3,228	-0.08%	-1,056	-35,100	36,256	35,827	-2,702
현대차	196,000	-0.25	84.6	71.7	51,898	-1,352	-0.07%	-2,950	742	2,232	1,203	1,031
삼성전기	142,500	-0.35	31.3	68.3	32,609	859	-0.02%	1,714	132	-1,846	-961	-885
한국금융지주	62,500	-1.57	5.0	64.3	27,607	-1,098	0.02%	-1,062	-10	1,066	740	326
SK 하이닉스	97,100	-0.51	111.9	58.1	187,332	3,124	-0.13%	1,467	3,368	-4,983	-4,930	1,312
LG 화학	613,000	1.83	89.5	52.9	10,674	-1,592	-0.09%	-931	-368	1,336	1,218	92
OCI	123,000	0.41	50.5	52.9	17,452	2,237	-0.07%	-1,067	3,062	-1,996	-1,488	-808
엔씨소프트	372,000	0.00	9.2	50.7	8,265	-96	0.01%	176	-211	35	-13	48
현대제철	33,800	-0.88	7.1	49.2	11,579	-473	-0.02%	-1,652	30	1,622	850	775

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터