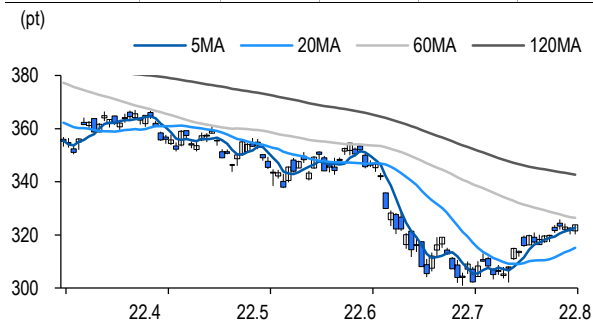


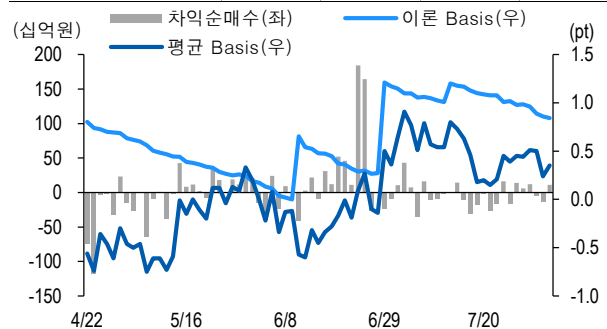
## 선물옵션시장 지표

2022.8.4

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	323.80	0.67	2.16	4,894.6	-
선물 9월물	324.15	0.82	2.65	18,167.0	304,817
선물 12월물	325.10	0.77	2.50	26.1	20,128
8월물(mini)	323.90	0.83	2.68	1,302.5	70,996
9월물(mini)	324.12	0.81	2.32	7.1	7,961



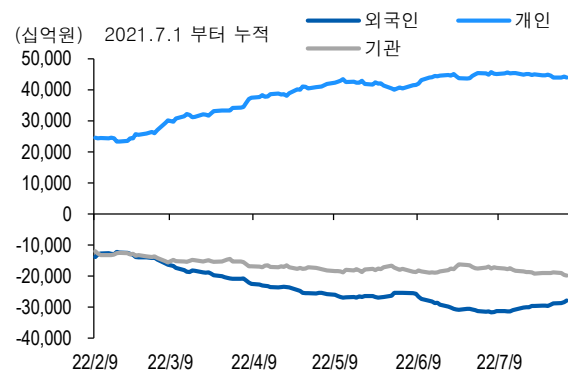
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.84	0.35	0.35	-0.15%
베이스스(mini)	0.16	0.04	0.10	-0.04%
제1스프레드(SP)	1.49	1.06	1.00	-0.13%
합성선물 베이스스(ATM)	0.16	0.05	0.05	-0.04%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	473.5	34.9	508.5	0.4	403.9	525.4	53.2	-1.2	-2.5	4.3
개인	-332.2	37.8	-294.4	0.0	-0.9	-284.2	-29.9	-0.7	2.1	9.7
기관	-144.3	-76.6	-221.0	10.9	-38.9	-234.4	-21.0	2.4	0.7	-13.6
금융투자	-35.3	-22.6	-57.9	-0.4	0.3	-480.7	-18.9	1.3	0.7	-7.7
투신	-47.6	-23.6	-71.3	0.0	-24.7	265.5	-2.0	0.1	0.0	11.6
은행+보험+기타금융	-8.0	-17.3	-25.2	0.0	-24.8	-12.5	-0.1	0.9	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-3.9	7.4	3.5	11.3	7.4	-6.7	0.0	0.0	0.0	-17.5
기타법인	3.0	3.9	6.9	0.0	0.8	-6.8	-2.3	-0.5	-0.2	-0.4

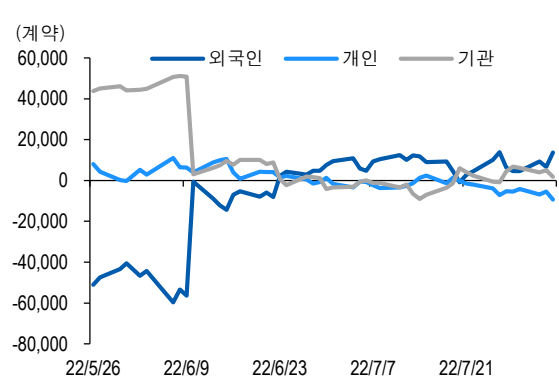
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

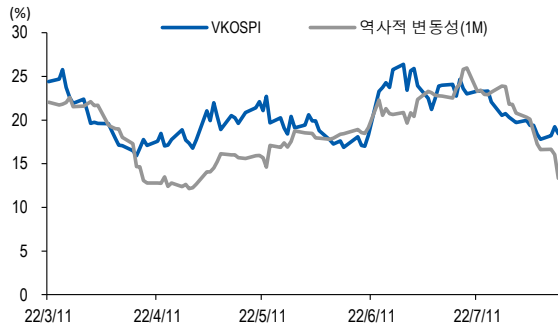
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	749,860	174.8	937,339	14.7%	지수옵션 전체	1,516,234	330.2	2,520,829
Put	766,374	155.4	1,583,490	18.4%	PCR(금액기준)	0.89	VKOSPI	18.45%(-0.79%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	0.88	0.20	169,338	32,473	506	14.4	Put	325.0(K+1)	3.82	-1.99	7,021	9,338	1,141	16.3
	327.5(K+2)	1.63	0.39	105,359	21,624	-33	15.0		322.5(K+0)	2.71	-1.65	19,623	10,059	2,055	16.9
	325.0(K+1)	2.69	0.64	77,709	22,288	462	15.5		320.0(K-1)	1.87	-1.39	39,128	14,873	1,054	17.5
	322.5(K+0)	4.06	0.94	30,085	16,842	-441	16.0		317.5(K-2)	1.28	-1.08	52,210	14,214	2,904	18.2
	320.0(K-1)	5.73	1.24	12,180	17,064	-493	16.6		315.0(K-3)	0.86	-0.83	85,733	22,700	3,199	18.9

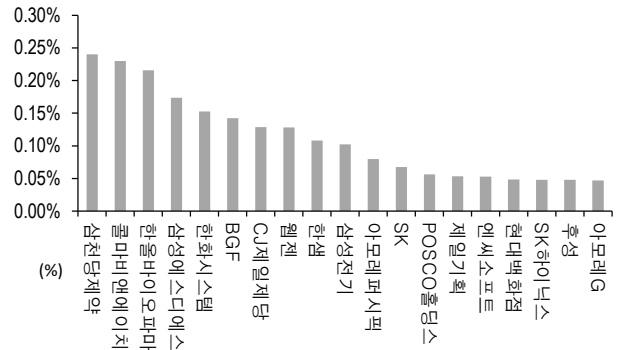
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	2,407,148	1,707.8	4,037,065	25,991	5,376	8,166	-13,750	4.3	9.7	-13.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	61,400	-0.32	534.4	87.4	1,079,409	-4,178	0.05%	-16,402	-6,519	22,621	15,039	-17,184
BGF	4,210	0.24	0.3	81.2	3,463	283	0.14%	1,106	2	-1,108	-1,108	0
LG 생활건강	765,000	0.00	21.1	66.4	1,371	-633	-0.10%	225	183	-408	114	288
현대차	197,500	0.25	81.5	60.8	55,027	2,457	0.03%	-557	1,326	-759	101	-860
넥센타이어	6,520	3.99	1.3	56.8	5,550	-1,586	-0.12%	2,378	42	-2,420	-2,420	0
일진머티리얼즈	75,200	1.35	7.7	54.3	49,010	321	-0.03%	1,855	-667	-1,188	-423	-765
현대엘리베이	28,600	0.53	1.2	53.7	3,148	-280	-0.12%	-298	19	279	273	6
삼성전기	140,500	-0.71	33.6	53.3	32,862	432	0.10%	-3,233	4,269	-1,036	-62	-1,043
KB 금융	47,700	0.32	14.8	51.1	27,927	-772	0.00%	1,223	-295	-928	-399	-529
호텔신라	71,500	0.56	4.4	50.9	13,374	956	-0.02%	1,157	-105	-1,052	-1,042	-10

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터