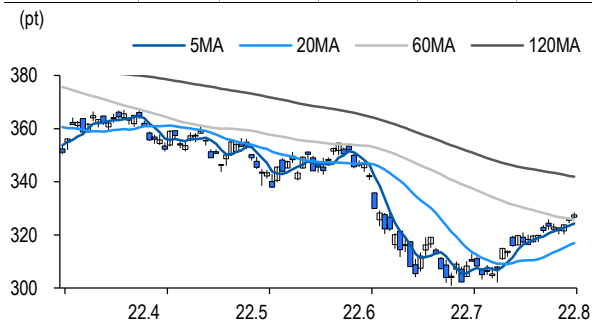


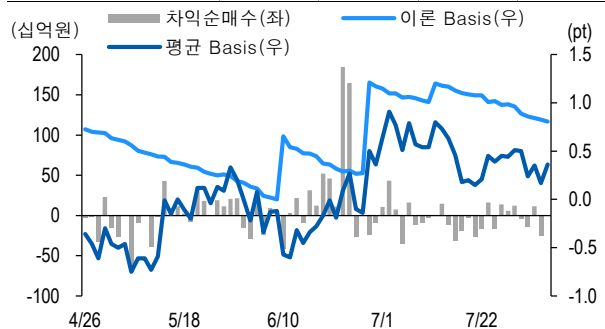
선물옵션시장 지표

2022.8.8

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	327.50	0.62	2.03	5,741.0	-
선물 9월물	327.35	0.49	1.60	16,232.8	308,722
선물 12월물	328.65	0.55	1.80	25.1	20,215
8월물(mini)	327.18	0.52	1.68	1,186.3	71,986
9월물(mini)	327.52	0.54	1.92	8.7	8,282



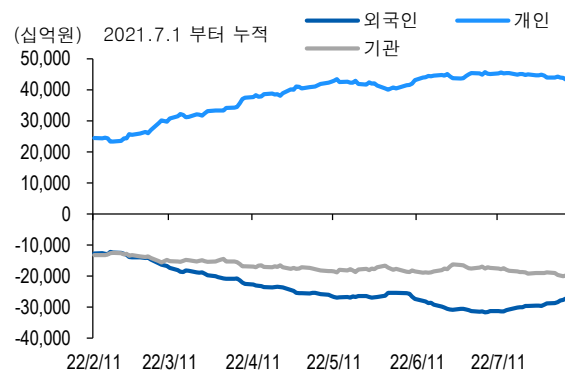
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.81	0.36	-0.15	-0.14%
베이스(mini)	0.12	0.01	-0.32	-0.03%
제1스프레드(SP)	1.52	1.12	1.15	-0.12%
합성선물 베이스(ATM)	0.12	-0.23	-0.23	-0.11%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	373.4	9.6	383.0	1.2	375.9	173.4	-38.4	-6.0	-0.2	23.0
개인	-417.0	-152.8	-569.8	0.0	-1.3	5.0	4.7	4.5	-1.8	-2.2
기관	45.9	143.7	189.6	-1.7	5.8	-204.9	29.9	1.4	2.3	-20.2
금융투자	100.5	146.3	246.8	0.0	1.4	-262.3	29.9	0.3	2.4	-17.4
투신	-22.9	2.9	-20.1	0.0	-17.3	26.6	0.0	0.8	0.0	16.4
은행+보험+기타금융	4.6	-14.9	-10.3	0.0	4.2	64.3	0.0	0.0	0.0	-0.1
연기금+국가지자체	-9.3	5.3	-4.0	-1.7	18.4	-33.6	0.0	0.3	-0.1	-19.2
기타법인	-2.3	-0.4	-2.8	0.0	-0.1	26.5	3.8	0.1	-0.3	-0.6

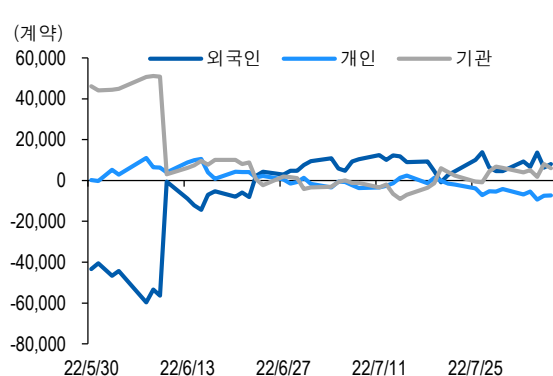
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



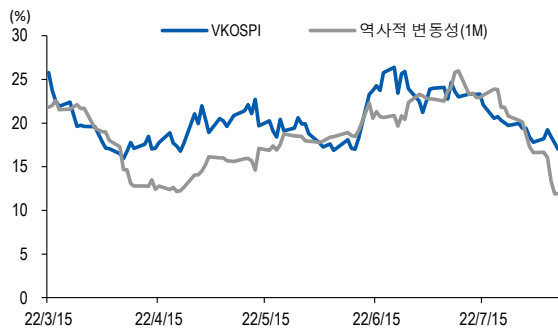
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	995,975	261.1	993,984	12.4%	지수옵션 전체	2,184,566	462.9	2,711,910
Put	1,188,591	201.8	1,717,926	16.1%	PCR(금액기준)	0.77	VKOSPI	17.00%(-0.70%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	332.5(K+3)	0.62	0.16	230,341	26,712	-1,021	12.4	Put	327.5(K+1)	2.65	-1.24	61,671	11,044	6,830	15.1
	330.0(K+2)	1.29	0.30	197,719	31,855	-2,220	12.5		325.0(K+0)	1.63	-0.99	115,558	18,200	4,510	15.3
	327.5(K+1)	2.38	0.53	107,246	18,854	-362	12.7		322.5(K-1)	0.95	-0.77	146,631	19,364	6,683	15.7
	325.0(K+0)	3.90	0.77	30,839	24,005	817	12.9		320.0(K-2)	0.52	-0.58	169,083	27,336	7,051	16.0
	322.5(K-1)	5.66	0.96	6,996	16,738	-343	12.0		317.5(K-3)	0.30	-0.37	124,604	21,596	5,157	16.8

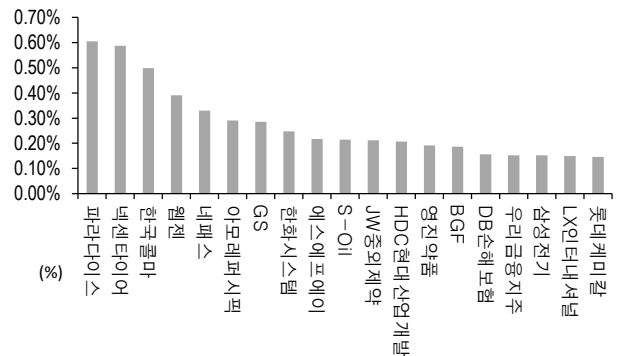
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,644,841	1,861.9	4,124,330	63,085	25,154	-31,140	6,745	23.0	-2.2	-20.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	61,600	0.16	432.5	74.0	1,047,250	-11,378	-0.02%	14,298	-11,937	-2,361	8,780	-18,507
현대차	194,500	-1.27	120.4	67.4	54,776	56	0.00%	785	481	-1,270	221	-820
삼성전기	141,500	0.35	33.5	64.0	31,911	-112	0.15%	-248	1,042	-903	-261	-1,289
KT	37,950	0.93	11.9	58.8	44,776	-677	-0.20%	-646	-6,214	6,860	5,140	1,620
일진머티리얼즈	76,200	-0.13	13.8	55.2	50,128	613	-0.02%	-1,515	993	522	-409	931
넥센타이어	6,640	1.53	0.6	48.9	5,436	-396	0.59%	398	-722	324	324	0
현대건설	42,150	0.96	5.5	48.3	13,104	-1,106	-0.08%	-304	-492	796	623	173
엔씨소프트	387,000	0.39	17.2	47.2	8,102	-109	0.01%	-154	-276	430	-165	418
LG 전자	96,100	0.00	18.9	44.3	22,547	-1,298	0.00%	-648	-1,407	2,055	204	1,851
아모레퍼시픽	129,500	1.57	11.5	43.5	12,469	-1,504	0.29%	1,999	402	-2,403	-3,126	-1,087

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터