

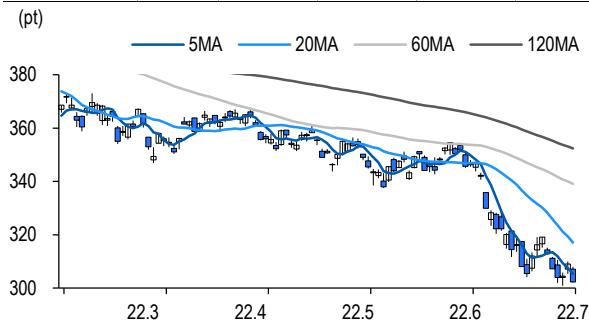


## 선물옵션시장 지표

2022.7.7

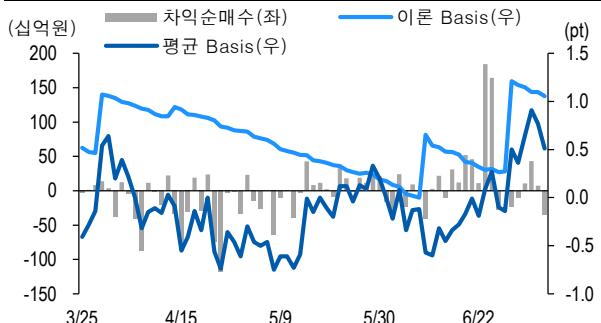
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	302.28	-2.18	-6.75	6,976.3	-
선물 9월물	303.30	-2.15	-6.65	30,696.3	318,956
선물 12월물	304.00	-2.16	-6.70	47.5	18,716
7월물(mini)	302.80	-2.08	-6.42	2,306.8	113,610
8월물(mini)	302.68	-2.19	-6.78	12.6	14,854



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.06	0.51	1.02	-0.18%
베이시스(mini)	0.14	0.03	0.52	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.84	0.74	0.75	-0.03%
합성선물 베이시스(ATM)	0.14	0.49	0.49	0.12%

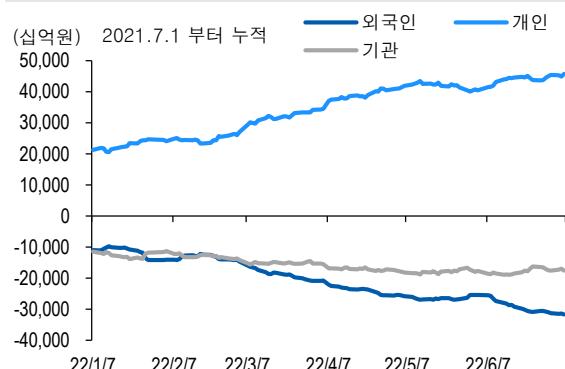


## 투자주체별 매매 동향 (십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-314.1	40.7	-273.4	-11.4	-72.1	-174.8	94.2	2.7	-27.1	-17.6
개인	897.0	-57.4	839.6	0.0	3.2	-27.4	3.9	-0.6	23.2	10.3
기관	-623.2	24.6	-598.6	-24.2	-34.1	160.4	-94.7	-1.8	3.9	6.9
금융투자	-466.8	70.0	-396.8	-7.3	1.2	728.4	-92.6	-0.8	3.8	-12.2
투신	-19.3	-27.7	-47.0	0.0	-9.9	-550.2	-2.2	-0.1	0.0	3.5
은행+보험+기타금융	-16.1	-6.3	-22.4	0.0	1.2	-35.0	0.1	-0.9	0.0	0.1
연기금+국가지자체	-50.8	-6.4	-57.2	-16.9	-17.3	17.2	0.0	0.0	0.0	15.4
기타법인	40.3	-7.9	32.4	0.0	-1.3	41.7	-3.4	-0.3	0.1	0.4

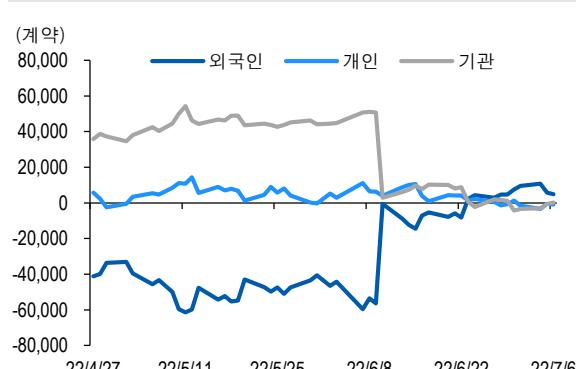
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

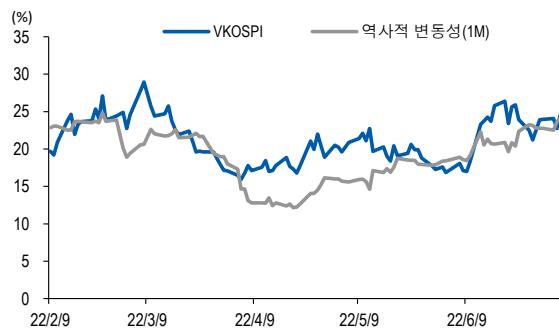
(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금
Call	1,448,673	275.5	1,348,827	20.4%	지수옵션 전체	2,632,176	653.9
Put	1,183,503	378.4	1,630,246	20.7%	PCR(금액기준)	1.37	VKOSPI 24.67% (+1.94%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	317.5(K+3)	0.26	-0.81	203,235	29,683	8,254	20.1	Put	312.5(K+1)	10.50	4.67	2,949	7,473	-172	17.0
	315.0(K+2)	0.45	-1.25	203,788	29,170	10,201	20.1		310.0(K+0)	8.56	4.09	11,025	20,642	-607	18.7
	312.5(K+1)	0.84	-1.75	131,352	16,811	6,209	20.9		307.5(K-1)	6.80	3.43	22,007	12,202	-442	19.6
	310.0(K+0)	1.33	-2.46	104,606	18,224	8,073	21.0		305.0(K-2)	5.28	2.82	26,737	15,128	-468	20.3
	307.5(K-1)	2.09	-3.03	39,167	11,061	2,927	21.7		302.5(K-3)	4.00	2.23	55,355	16,318	594	20.9

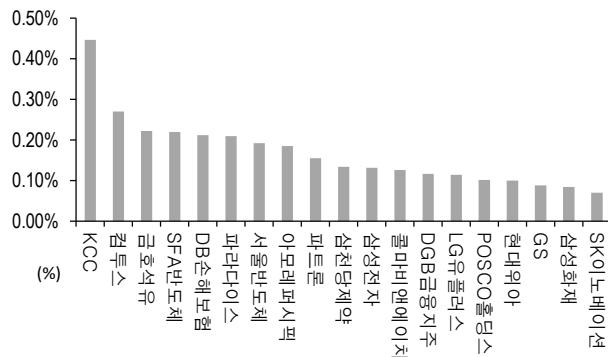
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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	4,229,489	2,715.6	4,389,287	-43,189	-71,564	52,160	20,622	-17.6	10.3	6.9
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
넥센타이어	5,300	-0.75	0.7	93.4	7,881	-1,127	-0.08%	203	-477	274
삼성전기	131,000	-1.13	77.6	85.6	31,570	708	-0.12%	315	572	-892
삼성전자	56,600	-1.57	802.2	84.1	1,254,101	-2,177	0.13%	8,553	10,084	-18,562
현대차	172,500	-2.54	124.0	77.2	43,774	-715	0.02%	-71	1,638	-1,571
호텔신라	68,600	-0.87	9.0	70.4	11,835	358	-0.05%	521	1,173	-1,699
아모레퍼시픽	131,500	1.94	20.9	66.5	11,349	-1,870	0.18%	1,550	165	-1,715
LG 이노텍	343,500	-2.28	39.1	64.8	9,421	-329	0.00%	7	153	-160
LG 화학	503,000	-2.14	61.2	62.9	7,157	-468	0.01%	-361	180	-297
일진머티리얼즈	69,500	-1.14	23.5	61.1	53,043	-2,178	0.03%	-1,701	224	1,469
SK 하이닉스	91,800	-0.97	218.9	59.7	203,326	-5,523	-0.04%	1,515	-6,821	5,555

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터