

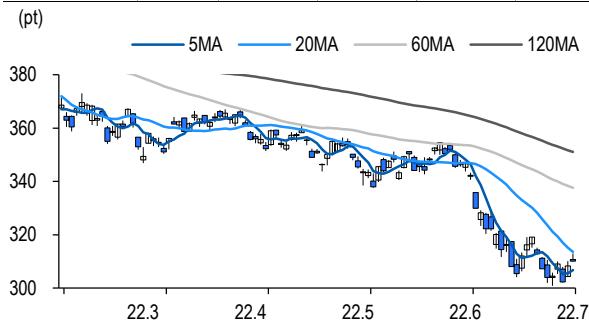


선물옵션시장 지표

2022.7.11

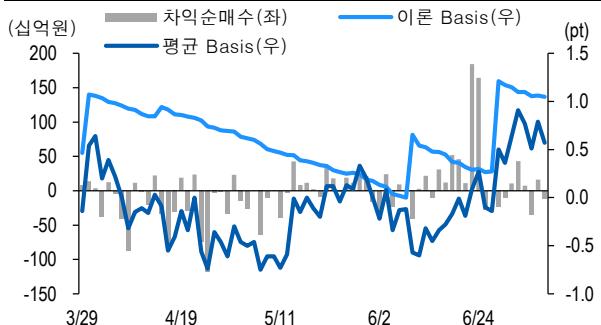
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	310.15	0.60	1.84	5,416.8	-
선물 9월물	310.80	0.60	1.85	24,720.6	306,769
선물 12월물	311.25	0.52	1.60	44.4	18,746
7월물(mini)	310.26	0.63	1.94	2,221.2	113,350
8월물(mini)	310.06	0.53	1.62	15.5	15,301



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.05	0.57	0.65	-0.15%
베이시스(mini)	0.10	0.02	0.11	-0.03%
제1스프레드(SP)	0.87	0.75	0.75	-0.04%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	-0.10	-0.10	-0.07%



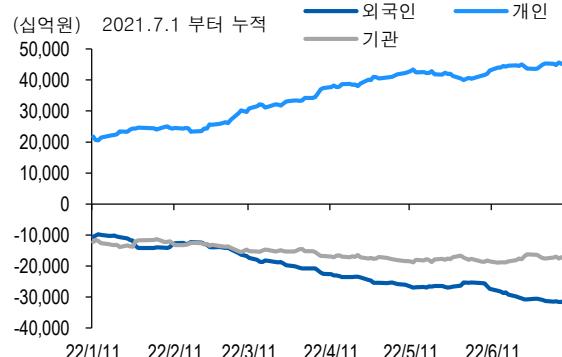
투자주체별 매매 동향

(십억원)

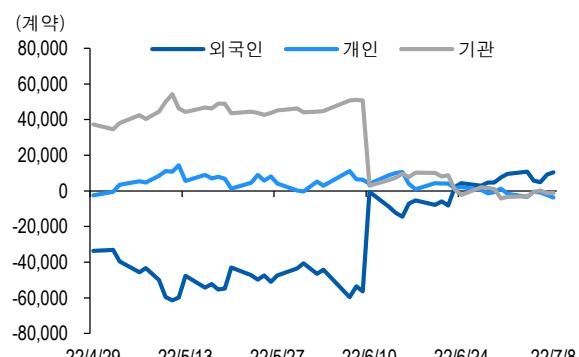
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	247.2	10.1	257.4	-4.7	119.2	-4.3	92.2	-0.4	8.3	-10.2
개인	-89.4	-9.9	-99.3	0.0	-4.9	-87.0	-16.3	3.1	-2.2	-26.7
기관	-171.8	-0.2	-172.1	-6.4	-13.7	73.7	-78.2	-2.5	-5.1	38.3
금융투자	-168.9	28.6	-140.3	-3.3	-2.1	355.0	-78.9	-3.0	-4.4	19.7
투신	3.0	-33.0	-30.0	0.0	-7.9	-313.3	0.2	0.1	-0.4	-12.3
은행+보험+기타금융	19.8	10.7	30.5	0.0	-4.4	29.0	0.4	0.5	-0.3	-0.9
연기금+국가지자체	-30.5	-2.2	-32.6	-3.0	-1.3	3.1	0.0	0.0	0.0	31.9
기타법인	14.0	-0.1	13.9	0.0	-0.7	17.6	2.4	-0.2	-1.0	-1.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,011,916	459.8	1,435,339	18.4%	지수옵션 전체	4,014,359	848.6	3,168,176
Put	2,002,443	388.9	1,732,837	21.2%	PCR(금액기준)	0.85	VKOSPI	23.00%(-0.60%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	315.0(K+3)	1.33	0.12	206,247	25,198	-451	18.2	Put
	312.5(K+2)	2.22	0.27	92,098	15,627	777	18.7	
	310.0(K+1)	3.41	0.41	43,236	20,099	1,586	19.1	
	307.5(K+0)	4.89	0.66	12,211	12,720	374	19.5	
	305.0(K-1)	6.59	0.81	4,722	8,842	-233	19.5	

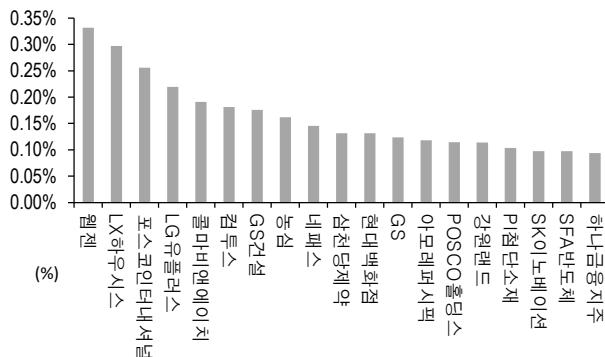
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	3,491,678	2,457.7	4,303,432	-48,236	2,795	-19,602	18,429	-10.2	-26.7	38.3	
<hr/>											
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
삼성전자	58,600	0.69	763.2	85.4	1,117,288	-102,042	0.00%	-27,019	-15,031	41,910	-4,498
넥센타이어	5,470	1.30	0.2	84.4	5,254	-1,156	-0.13%	526	-721	195	0
에코프로비엠	118,700	2.95	35.9	81.3	19,338	-2,848	-0.39%	-22	1,577	-1,323	-1,729
현대차	178,000	2.01	119.4	81.3	45,642	1,525	-0.07%	714	187	-901	-1,512
삼성전기	134,500	0.75	61.0	75.4	29,449	-95	-0.19%	-589	-817	1,406	386
호텔신라	69,700	0.87	6.0	70.4	10,457	-884	0.01%	-456	784	-363	-284
SK 하이닉스	94,800	0.85	187.5	69.8	176,144	-23,899	-0.10%	911	-26,468	25,566	27,681
현대건설	39,500	0.51	12.9	65.8	15,787	-2,048	-0.04%	-3,404	3,496	-92	-911
기아	76,900	1.59	49.5	59.7	48,921	-2,565	0.04%	-1,063	4,944	-3,879	-1,311
LG 화학	541,000	3.24	88.0	59.1	7,028	49	0.04%	150	-466	321	461

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터