

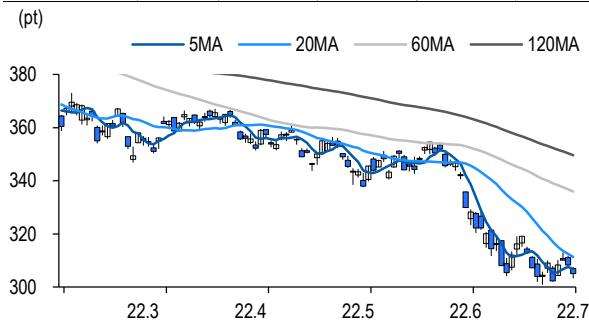


선물옵션시장 지표

2022.7.13

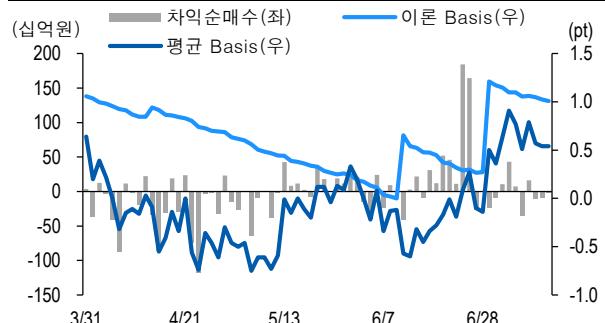
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	305.03	-1.06	-3.26	4,513.8	-
선물 9월물	305.55	-1.15	-3.55	20,234.7	305,672
선물 12월물	306.45	-1.11	-3.45	35.1	18,885
7월물(mini)	304.92	-1.17	-3.60	1,743.1	125,241
8월물(mini)	305.32	-1.13	-3.48	41.6	19,859



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.01	0.54	0.52	-0.15%
베이시스(mini)	0.04	0.00	-0.11	-0.01%
제1스프레드(SP)	0.85	0.76	0.75	-0.03%
합성선물 베이시스(ATM)	0.04	0.05	0.05	0.00%



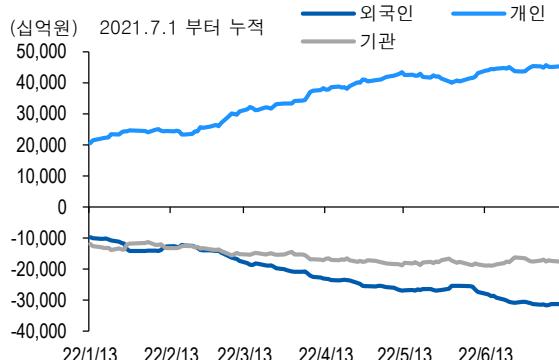
투자주체별 매매 동향

(십억원)

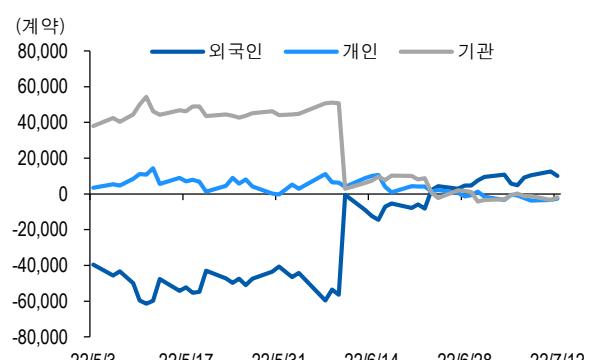
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-44.6	6.0	-38.5	-8.6	23.4	-208.2	20.6	3.1	-3.7	13.3
개인	267.7	-55.4	212.3	0.0	-1.0	23.1	36.6	-3.3	6.2	-0.3
기관	-238.1	50.6	-187.5	5.9	-8.9	167.9	-57.7	0.1	-3.9	-12.7
금융투자	-143.9	-19.9	-163.8	1.3	-1.2	303.8	-58.2	0.5	-4.6	0.1
투신	-47.2	11.7	-35.4	0.0	-23.1	-161.0	0.0	-0.4	0.0	-7.8
은행+보험+기타금융	4.9	26.2	31.1	0.0	0.9	29.9	0.5	0.0	0.7	0.0
연기금+국가지자체	6.1	10.4	16.5	4.7	24.3	-4.8	0.0	0.0	0.0	-5.0
기타법인	15.0	-1.2	13.8	0.0	-0.4	17.3	0.5	0.1	1.4	-0.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	1,711,959	263.4	1,513,373	20.2%	지수옵션 전체		3,326,136	676.7	3,346,802		
Put	1,614,177	413.3	1,833,429	21.8%	PCR(금액기준)		1.57	VKOSPI	23.33%(0.00%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	315.0(K+3)	0.09	-0.55	251,713	39,043	6,680	20.1	310.0(K+1)	5.56	2.03	13,204
	312.5(K+2)	0.22	-1.01	316,627	30,258	11,348	19.5	307.5(K+0)	3.68	1.34	52,875
	310.0(K+1)	0.59	-1.54	320,211	29,069	7,008	20.2	305.0(K-1)	2.34	0.90	133,753
	307.5(K+0)	1.26	-2.16	200,276	17,336	4,690	20.5	302.5(K-2)	1.30	0.49	223,387
	305.0(K-1)	2.35	-2.67	94,339	14,657	5,784	20.9	300.0(K-3)	0.68	0.23	361,785
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	310.0(K+1)	5.56	2.03	13,204	21,388	-1,053	20.8	307.5(K+0)	3.68	1.34	52,875
	307.5(K+0)	3.68	1.34	52,875	16,825	455	20.5	305.0(K-1)	2.34	0.90	133,753
	305.0(K-1)	2.34	0.90	133,753	17,481	-1,428	21.6	302.5(K-2)	1.30	0.49	223,387
	302.5(K-2)	1.30	0.49	223,387	25,688	-2,462	21.6	300.0(K-3)	0.68	0.23	361,785
	300.0(K-3)	0.68	0.23	361,785	41,890	-3,987	22.1				

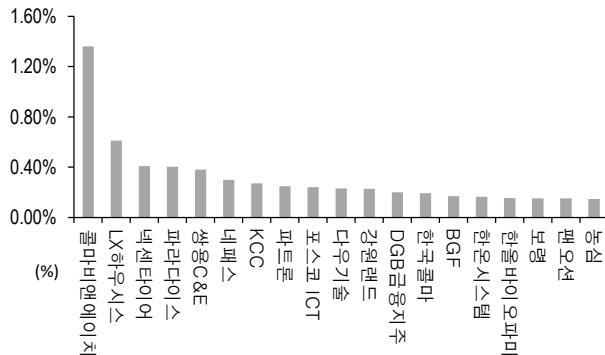
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,033,465	2,055.9	4,362,954	-6,279	-12,011	-1,025	14,599	13.3	-0.3	-12.7	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
에코프로비엠	110,400	-3.41	42.4	132.2	14,204	-3,843	-0.43%	515	-73	-572	-703
삼성전기	132,000	-1.49	52.4	121.1	25,836	-3,392	-0.18%	-1,179	530	649	807
현대차	179,000	0.00	108.4	112.7	40,973	-2,575	-0.10%	2,171	-1,711	-455	602
삼성전자	58,300	-0.85	521.7	96.1	775,908	-124,740	0.04%	9,070	9,954	-18,954	1,234
삼성 SDI	528,000	0.19	65.9	71.9	15,302	-2,013	0.03%	525	217	-742	-374
SK 하이닉스	93,700	0.21	150.2	68.0	123,630	-38,937	-0.07%	-4,710	-2,267	7,206	6,109
기아	78,700	0.77	51.7	61.7	30,950	-8,816	-0.01%	-814	-825	1,627	-457
LG 이노텍	328,500	-2.95	35.0	57.5	4,700	-2,215	0.06%	13	556	-569	-99
KB 금융	46,000	-1.81	17.1	51.2	33,560	-2,114	0.02%	154	-744	590	775
일진마티리얼즈	66,300	-4.05	10.2	48.8	38,520	-9,223	-0.09%	961	-2,057	1,088	894

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터