

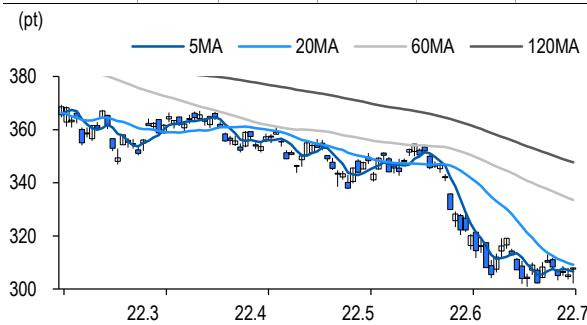


선물옵션시장 지표

2022.7.18

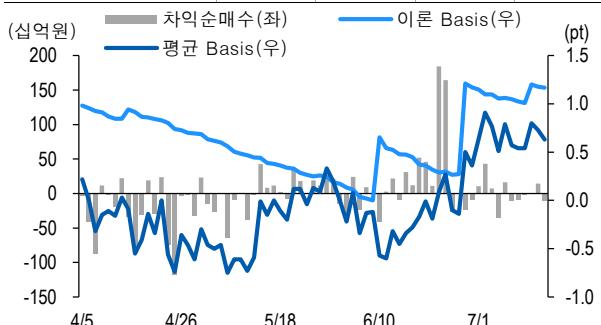
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	307.91	0.84	2.56	5,422.4	-
선물 9월물	308.00	0.46	1.40	29,552.2	291,739
선물 12월물	308.90	0.47	1.45	37.7	19,604
8월물(mini)	307.78	0.51	1.56	2,510.0	45,606
9월물(mini)	308.08	0.48	1.58	16.2	7,636



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.17	0.63	0.09	-0.17%
베이시스(mini)	0.56	0.29	-0.13	-0.09%
제1스프레드(SP)	1.27	0.87	0.95	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.56	-0.07	-0.07	-0.20%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

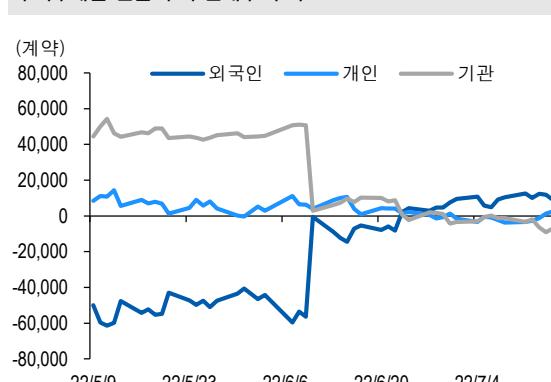
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	263.3	-4.3	259.0	-3.7	101.8	-205.2	24.9	5.0	1.4	-1.4
개인	-20.8	6.3	-14.5	0.0	0.6	45.9	-9.7	-2.9	-3.8	17.5
기관	-262.6	-6.6	-269.3	-7.7	-12.9	174.3	-12.6	-1.9	3.3	-18.8
금융투자	-292.5	-18.2	-310.7	1.3	1.3	-62.2	-12.6	-1.3	5.7	25.0
투신	-15.0	5.9	-9.1	0.0	-14.5	259.3	0.0	-0.6	-0.3	-6.2
은행+보험+기타금융	5.0	3.9	9.0	0.0	-0.9	-32.6	0.0	0.0	-2.1	0.1
연기금+국가지자체	19.1	6.3	25.4	-9.1	3.4	9.9	0.0	0.0	0.0	-37.7
기타법인	20.2	4.7	24.9	0.0	-2.6	-15.0	-2.6	-0.2	-0.9	2.7

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	788,337	251.5	691,816	19.2%	지수옵션 전체		1,633,071	550.9	1,702,574		
Put	844,734	299.4	1,010,758	22.2%	PCR(금액기준)		1.19	VKOSPI	22.08%(-1.24%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	312.5(K+3)	4.71	0.38	12,046	2,887	1,040	19.0	307.5(K+1)	6.85	-1.06	7,265
	310.0(K+2)	5.84	0.41	9,172	6,337	619	19.3	305.0(K+0)	5.74	-1.06	11,051
	307.5(K+1)	7.12	0.53	10,605	3,567	1,114	19.5	302.5(K-1)	4.85	-0.92	8,297
	305.0(K+0)	8.58	0.56	7,517	3,644	425	19.8	300.0(K-2)	4.03	-0.92	12,305
	302.5(K-1)	10.30	0.60	3,669	2,076	1,433	20.5	297.5(K-3)	3.36	-0.83	10,582
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	307.5(K+1)	6.85	-1.06	7,265	3,682	1,172	21.6	305.0(K+0)	5.74	-1.06	11,051
	305.0(K+0)	5.74	-1.06	11,051	10,080	1,201	21.7	302.5(K-1)	4.85	-0.92	8,297
	302.5(K-1)	4.85	-0.92	8,297	4,043	1,517	22.1	300.0(K-2)	4.03	-0.92	12,305
	300.0(K-2)	4.03	-0.92	12,305	18,019	266	22.4	297.5(K-3)	3.36	-0.83	10,582
	297.5(K-3)	3.36	-0.83	10,582	3,771	817	22.8	300.0(K-2)	4.03	-0.92	12,305

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율

