

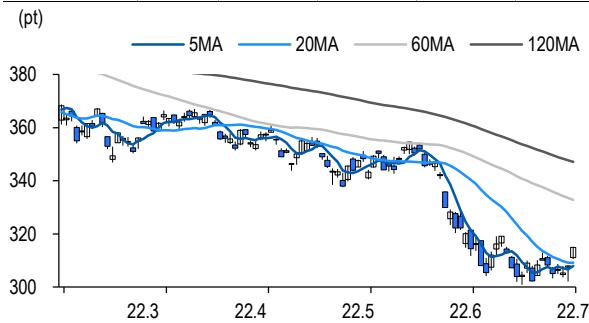


## 선물옵션시장 지표

2022.7.19

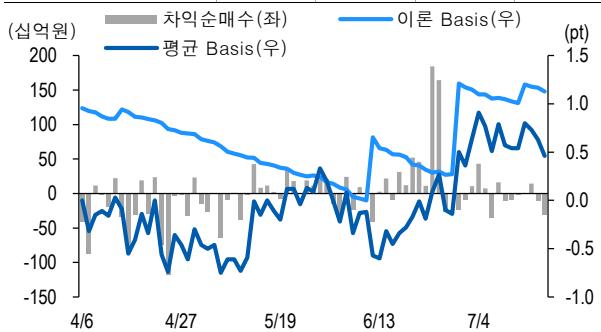
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	314.87	2.26	6.96	5,306.1	-
선물 9월물	316.00	2.60	8.00	21,112.6	292,300
선물 12월물	316.50	2.46	7.60	36.3	19,661
8월물(mini)	315.62	2.55	7.84	1,601.1	48,025
9월물(mini)	315.58	2.46	7.50	6.0	7,617



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.13	0.46	1.13	-0.21%
베이시스(mini)	0.50	0.18	0.75	-0.10%
제1스프레드(SP)	1.32	0.89	0.90	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.50	0.38	0.38	-0.04%

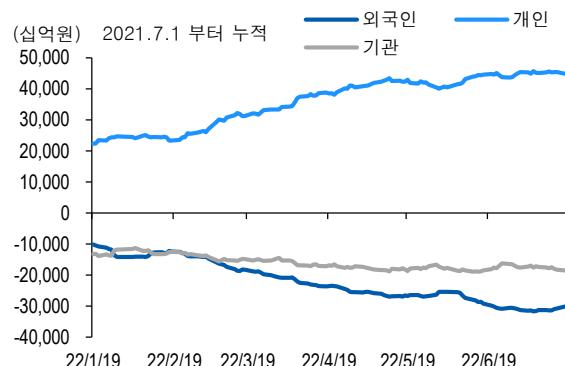


## 투자주체별 매매 동향 (십억원)

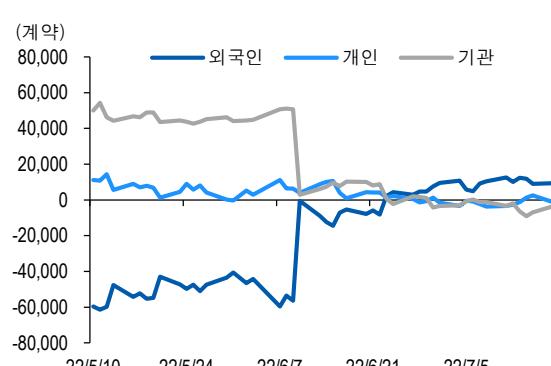
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	627.3	10.8	638.1	-5.5	322.7	-121.1	144.8	1.9	5.5	2.2
개인	-421.6	-19.8	-441.4	0.0	-0.6	-235.5	-59.1	1.2	-5.2	29.1
기관	-200.0	-18.5	-218.5	-25.9	-5.5	360.7	-83.3	-2.6	0.2	-31.2
금융투자	-266.8	-78.6	-345.4	-4.0	-3.7	-17.1	-84.8	-3.6	2.7	2.4
투신	18.0	-1.6	16.5	0.0	-3.5	371.4	1.4	0.0	-0.1	-0.1
은행+보험+기타금융	20.9	62.1	83.0	0.0	6.1	-14.6	0.0	1.0	-2.4	-0.2
연기금+국가지자체	-2.1	-1.7	-3.9	-21.9	-2.1	20.9	0.0	0.0	0.0	-33.3
기타법인	-5.7	27.6	21.8	0.0	0.7	-4.0	-2.3	-0.5	-0.5	0.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

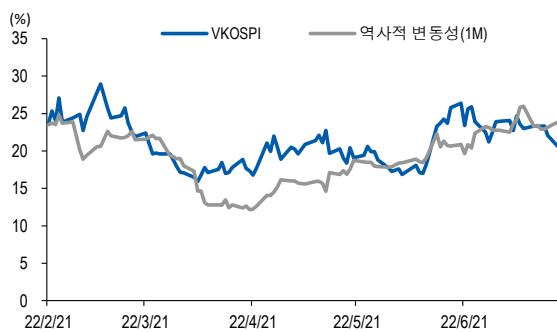
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	694,819	245.1	742,737	19.5%	지수옵션 전체	1,511,354	430.8	1,858,973
Put	816,535	185.7	1,116,236	20.7%	PCR(금액기준)	0.76	VKOSPI	20.53%(-1.55%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	315.0(K+3)	6.60	2.87	13,905	12,256	331	19.5	Put
	312.5(K+2)	8.06	3.35	6,647	3,097	210	19.9	310.0(K+1)
	310.0(K+1)	9.67	3.83	6,699	6,690	353	20.4	307.5(K+0)
	307.5(K+0)	11.05	3.93	2,136	3,357	-210	19.6	305.0(K-1)
	305.0(K-1)	12.90	4.32	1,606	3,775	131	19.9	302.5(K-2)
<hr/>								
300.0(K-3)								

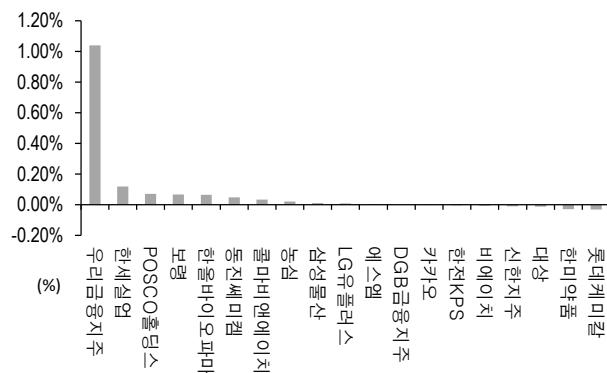
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	3,332,216	2,287.2	3,654,465	149,472	74,773	41,718	-118,090	2.2	29.1	-31.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	5,860	5.21	1.5	196.3	5,792	1,873	-0.07%	342	907	-1,249
삼성 SDI	545,000	-1.09	68.3	80.7	15,426	-845	-0.09%	210	-459	242
엔씨소프트	368,500	1.10	15.1	69.5	7,508	317	-0.04%	599	0	-494
현대차	185,500	1.09	88.9	68.8	40,747	615	-0.10%	-2,079	235	1,793
삼성전기	140,000	0.72	58.9	65.4	24,762	-931	-0.11%	-2,740	-311	3,050
삼성전자	62,000	3.33	802.2	63.6	1,142,986	33,372	-0.13%	-22,521	22,049	253
LG 이노텍	345,000	1.47	46.9	62.8	8,618	134	-0.12%	-402	306	96
SK 하이닉스	101,000	2.23	288.0	62.2	187,981	16,723	-0.46%	-5,205	-34,531	39,718
카카오	73,000	4.14	73.2	60.3	71,606	20,266	0.00%	4,597	19,145	-23,745
LG 화학	516,000	0.19	49.0	59.6	8,112	506	-0.07%	839	325	-1,160

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터