

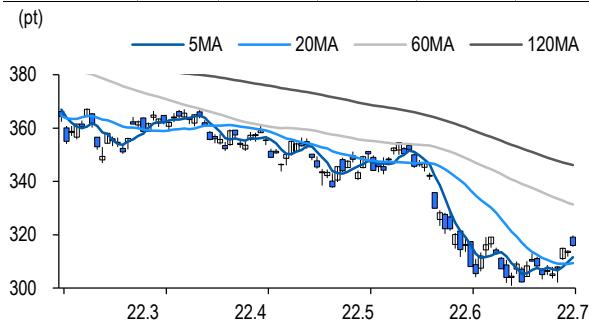


선물옵션시장 지표

2022.7.21

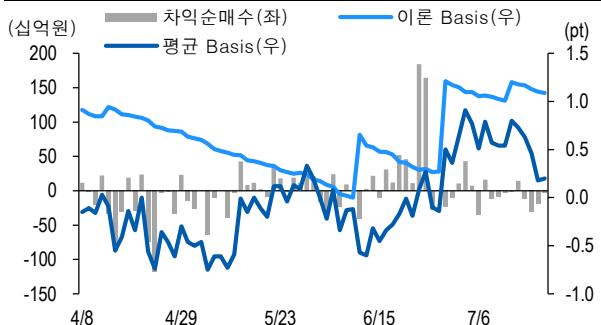
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.02	0.68	2.12	5,670.1	-
선물 9월물	316.50	0.89	2.80	21,935.8	297,616
선물 12월물	317.50	0.89	2.80	39.2	19,713
8월물(mini)	316.30	0.91	2.84	1,466.3	55,720
9월물(mini)	316.48	0.89	2.58	3.4	7,526



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.09	0.20	0.48	-0.28%
베이시스(mini)	0.46	0.03	0.28	-0.14%
제1스프레드(SP)	1.32	0.99	1.00	-0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	0.46	0.22	0.22	-0.08%



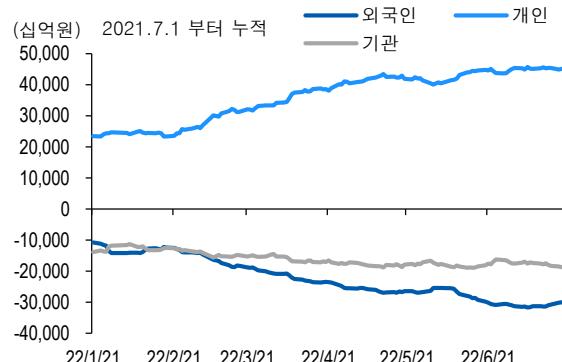
투자주체별 매매 동향

(십억원)

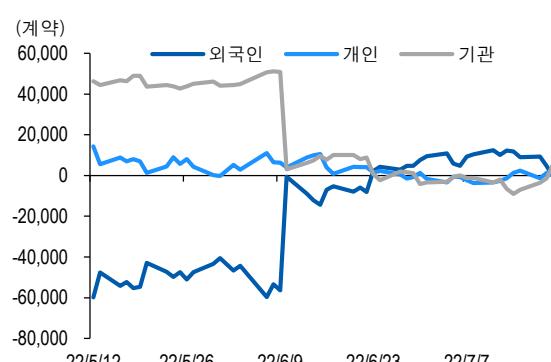
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-41.1	17.2	-23.9	-5.4	35.2	-456.0	26.8	-2.4	3.0	-12.7
개인	64.5	-77.5	-12.9	0.0	-2.7	-104.1	-3.4	2.4	-4.1	17.9
기관	-58.6	44.1	-14.6	2.5	-31.2	604.7	-22.6	-0.1	1.3	-15.7
금융투자	-57.1	-42.1	-99.3	-10.1	-0.2	311.0	-22.9	-0.4	1.4	-28.6
투신	7.8	1.5	9.3	0.0	-7.5	264.5	0.3	0.0	0.0	6.0
은행+보험+기타금융	-6.8	-0.8	-7.7	0.0	-4.8	44.8	0.0	0.4	0.0	1.1
연기금+국가지자체	-23.2	63.5	40.3	14.3	-14.0	-15.6	0.0	0.0	0.0	5.7
기타법인	35.2	16.2	51.4	0.0	-0.2	-44.7	-0.7	0.0	-0.3	10.6

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	736,627	239.0	820,318	17.8%	지수옵션 전체		1,481,162	409.6	2,048,859
Put	744,535	170.6	1,228,541	20.2%	PCR(금액기준)		0.71	VKOSPI	20.31%(-0.43%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	322.5(K+3)	3.18	0.71	19,270	15,421	-237	17.8	317.5(K+1)	6.55
	320.0(K+2)	4.16	0.87	17,942	16,070	280	18.0	315.0(K+0)	5.41
	317.5(K+1)	5.34	1.05	6,663	10,058	181	18.4	312.5(K-1)	4.40
	315.0(K+0)	6.65	1.20	8,524	13,382	525	18.6	310.0(K-2)	3.56
	312.5(K-1)	8.19	1.42	2,563	3,742	-169	19.0	307.5(K-3)	2.88
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	322.5(K+3)	3.18	0.71	19,270	15,421	-237	17.8	317.5(K+1)	6.55
	320.0(K+2)	4.16	0.87	17,942	16,070	280	18.0	315.0(K+0)	5.41
	317.5(K+1)	5.34	1.05	6,663	10,058	181	18.4	312.5(K-1)	4.40
	315.0(K+0)	6.65	1.20	8,524	13,382	525	18.6	310.0(K-2)	3.56
	312.5(K-1)	8.19	1.42	2,563	3,742	-169	19.0	307.5(K-3)	2.88

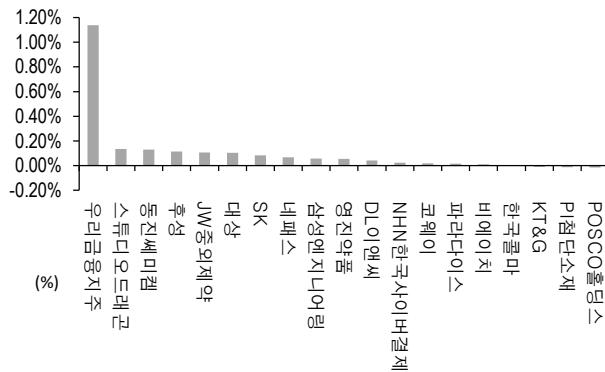
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,086,316	2,133.1	3,799,524	84,125	-28,198	42,207	-31,350	-12.7	17.9	-15.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	6,110	3.04	0.8	82.5	6,498	-1,626	-0.31%	-1,787	-1,517	3,304
삼성전기	140,000	0.00	50.2	79.5	27,950	2,249	-0.07%	-2,743	4,609	-1,866
SK 하이닉스	102,000	1.49	318.5	78.4	181,801	-16,609	-0.30%	1,476	-20,456	18,920
삼성전자	60,800	-0.49	698.5	68.2	1,218,441	45,504	-0.02%	-370	4,788	-21,520
카카오	73,400	0.55	80.4	61.6	75,209	6,244	-0.04%	-4,444	9,273	-4,829
현대건설	38,900	-0.26	7.3	54.7	12,875	-1,057	-0.14%	-2,015	468	1,547
현대차	189,000	0.27	95.2	50.9	44,477	1,655	-0.09%	-3,092	1,747	1,184
LG 화학	538,000	3.07	60.8	50.5	8,604	869	-0.08%	-688	868	-192
GS 건설	28,950	0.00	7.6	47.5	20,563	-536	-0.08%	-2,348	3,343	-995
NAVER	246,500	0.82	74.1	47.0	30,814	1,465	-0.09%	1,086	1,647	-2,733

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터