

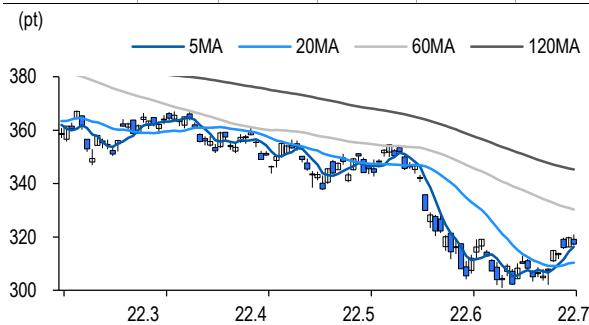


선물옵션시장 지표

2022.7.25

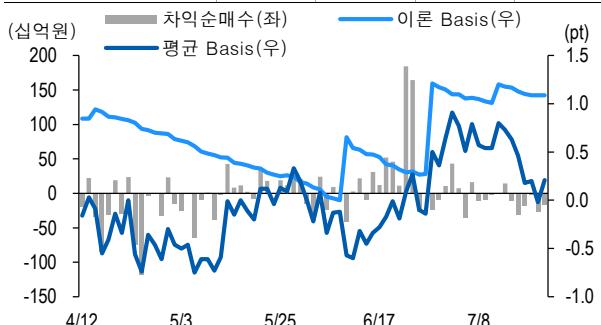
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	317.33	-0.74	-2.35	5,127.2	-
선물 9월물	318.20	-0.19	-0.60	20,252.0	291,900
선물 12월물	319.10	-0.23	-0.75	30.0	19,753
8월물(mini)	317.92	-0.21	-0.66	1,428.7	67,256
9월물(mini)	318.08	-0.23	-0.74	3.2	7,546



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.09	0.20	0.87	-0.28%
베이시스(mini)	0.46	0.03	0.59	-0.14%
제1스프레드(SP)	1.32	0.99	1.05	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.46	0.22	0.59	-0.08%



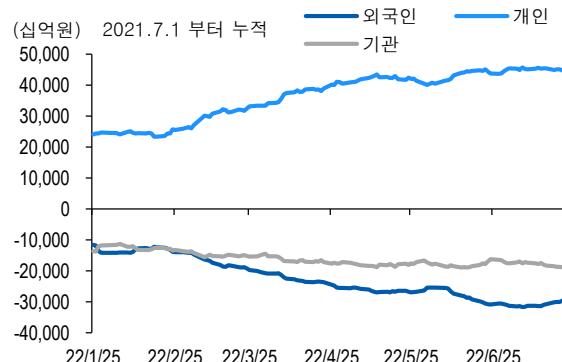
투자주체별 매매 동향

(십억원)

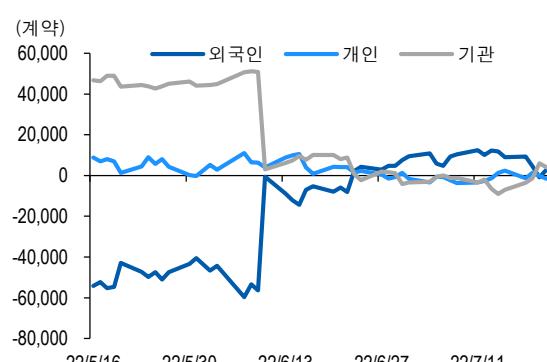
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	31.0	44.8	75.8	-0.8	-69.1	125.8	17.9	-0.9	-0.6	-8.2
개인	261.1	-11.7	249.4	0.0	0.0	-39.6	-3.1	1.6	-0.6	11.1
기관	-305.9	-33.3	-339.2	-15.9	-32.5	-114.2	-20.0	-0.7	1.3	-5.5
금융투자	-96.8	-4.9	-101.6	-14.4	-4.2	286.7	-19.4	-0.5	0.7	15.3
투신	-51.5	-2.9	-54.4	0.0	-13.2	-400.5	-0.6	0.0	0.1	-42.8
은행+보험+기타금융	-18.4	-19.4	-37.9	-6.3	-4.7	7.7	0.0	-0.2	0.5	-0.3
연기금+국가지자체	-39.2	1.1	-38.1	9.6	-7.0	-8.1	0.0	0.0	0.0	22.3
기타법인	13.8	0.2	14.0	0.0	0.0	28.0	5.2	0.1	-0.1	2.6

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	639,315	189.0	863,847	16.9%	지수옵션 전체	1,282,127	384.2	2,169,348							
Put	642,812	195.2	1,305,501	18.5%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	19.71%(-0.31%)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	1.70	-0.42	65,028	20,138	-905	16.8	Put	322.5(K+1)	7.87	0.29	1,908	1,072	153	16.9
	325.0(K+2)	2.44	-0.50	43,345	25,983	1,102	17.2		320.0(K+0)	6.48	0.06	6,466	5,889	700	17.4
	322.5(K+1)	3.34	-0.54	12,931	15,787	-69	17.6		317.5(K-1)	5.28	-0.01	7,576	5,295	1,077	17.8
	320.0(K+0)	4.40	-0.64	10,852	15,832	-244	17.9		315.0(K-2)	4.25	-0.01	13,213	11,778	1,177	18.3
	317.5(K-1)	5.69	-0.71	6,160	10,092	-72	18.3		312.5(K-3)	3.38	-0.08	13,345	10,071	257	18.7

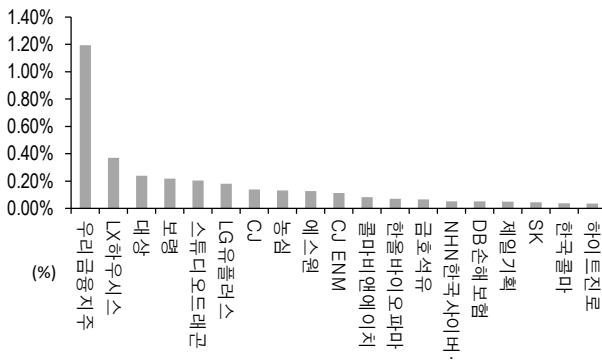
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 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	2,600,380	1,950.9	3,858,916	3,023	-26,319	-9,598	33,536	-8.2	11.1	-5.5		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리를 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	6,310	-0.32	1.1	120.5	10,045	797	-0.18%	-836	1,049	-213	-213	0
삼성전자	61,300	-0.65	590.0	93.5	1,209,363	-11,968	-0.15%	-19,782	-15,511	34,710	36,845	51,105
LG 화학	562,000	-0.71	68.6	75.9	10,036	833	-0.07%	166	1,021	-1,211	-333	-958
LG 이노텍	343,000	0.44	52.2	70.6	8,295	1,340	-0.03%	-874	352	524	-374	-233
삼성전기	143,500	-0.35	35.4	70.5	28,963	-1,341	-0.18%	-928	-922	1,850	343	1,534
현대차	191,500	1.32	181.0	69.0	49,038	-726	-0.10%	840	-3,105	2,213	712	1,321
CJ CGV	21,000	-2.33	1.8	67.6	29,287	2,053	-0.93%	-444	2,206	-1,762	138	0
SK 하이닉스	100,000	-2.91	211.0	67.3	199,092	14,131	-0.16%	2,293	26,902	-29,232	-6,483	-2,600
다우기술	18,650	0.81	0.2	62.0	1,933	252	-0.42%	269	-37	-232	-236	4
삼성 SDI	568,000	-0.18	48.8	60.2	17,388	287	-0.04%	481	-29	-452	-177	-352

자료: KBX 유파티^{증권} 리서치센터