

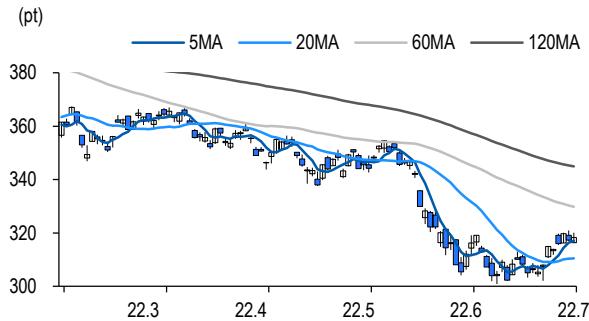


선물옵션시장 지표

2022.7.26

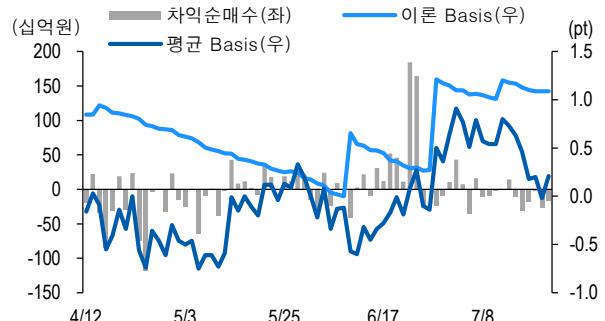
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	318.34	0.32	1.01	4,445.3	-
선물 9월물	319.10	0.28	0.90	20,066.7	294,138
선물 12월물	320.10	0.31	1.00	41.0	19,786
8월물(mini)	318.76	0.26	0.84	1,503.0	65,573
9월물(mini)	318.94	0.23	0.86	2.5	7,506



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.09	0.20	0.76	-0.28%
베이시스(mini)	0.46	0.03	0.42	-0.14%
제1스프레드(SP)	1.32	0.99	0.95	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.46	0.22	0.45	-0.08%



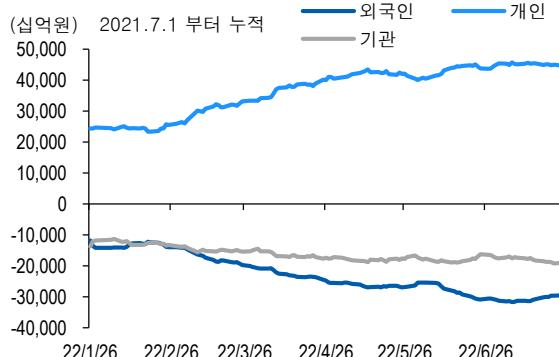
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	90.1	-24.9	65.2	11.5	93.0	493.6	-43.0	-1.7	0.9	21.7
개인	-280.7	-5.9	-286.5	0.0	2.2	-153.7	2.1	1.0	-1.4	-42.7
기관	193.2	33.4	226.6	4.8	-3.4	-282.4	38.1	0.8	0.7	19.8
금융투자	201.9	71.9	273.8	0.0	2.8	-383.2	38.1	0.5	0.8	-2.0
투신	32.5	-18.8	13.7	0.0	20.3	124.7	-0.1	0.0	0.0	-6.9
은행+보험+기타금융	3.0	-2.7	0.3	0.0	-6.5	-16.4	0.1	0.2	-0.1	15.4
연기금+국가지자체	-63.3	-7.3	-70.5	4.8	-23.0	-7.6	0.0	0.0	0.0	13.2
기타법인	-2.6	-2.6	-5.2	0.0	1.3	-57.5	2.7	-0.1	-0.2	1.3

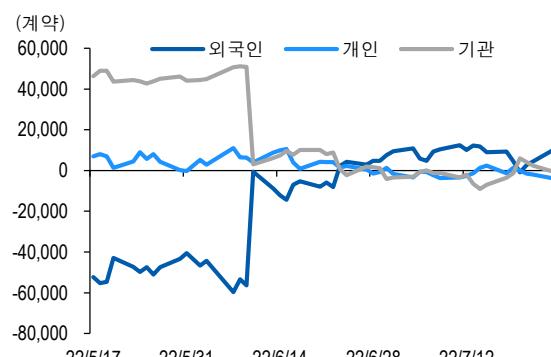
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

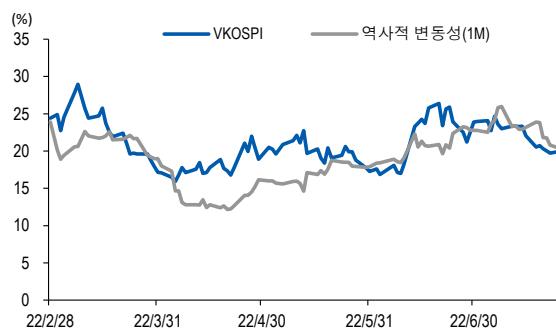


선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)					
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정				
Call	635,292	200.9	882,491	17.6%	지수옵션 전체		1,281,964	382.3	2,211,219				
Put	646,672	181.5	1,328,728	19.6%	PCR(금액기준)		0.90	VKOSPI		19.97%(+0.26%p)			
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내체변동성	Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	
	325.0(K+3)	2.46	0.02	55,247	26,159	176	17.5		320.0(K+1)	5.73	-0.75	7,245	6,283
	322.5(K+2)	3.40	0.06	25,486	16,111	324	17.8		317.5(K+0)	4.61	-0.67	7,679	5,787
	320.0(K+1)	4.55	0.15	16,389	16,906	1,074	18.2		315.0(K-1)	3.67	-0.58	18,849	11,338
	317.5(K+0)	5.90	0.21	6,674	10,282	190	18.7		312.5(K-2)	2.85	-0.53	17,672	10,837
	315.0(K-1)	7.45	0.29	2,744	13,561	-436	19.2		310.0(K-3)	2.22	-0.43	40,689	14,681

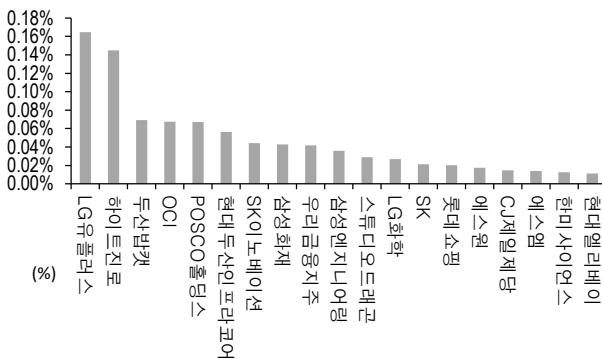
자료: KRX, 유안티증권 리서치센트

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안티증권 리서치센-

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	2,221,046	1,679.1	3,889,485	30,569	13,448	-63,842	48,830	21.7	-42.7	19.8		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	6,280	-0.48	0.5	142.3	9,555	-490	-0.27%	-293	-445	738	738	0
삼성전기	143,000	-0.35	32.1	84.3	28,995	32	-0.01%	-448	415	33	-499	518
삼성전자	61,200	-0.16	435.7	78.7	1,186,410	-22,953	-0.09%	21,553	-34,971	13,418	27,287	-19,100
BGF	4,260	1.67	0.4	78.6	3,775	-524	-0.68%	-626	143	483	483	0
LG 이노텍	344,500	0.44	21.1	75.3	8,004	-291	0.00%	283	-9	-274	-383	110
현대제철	33,350	0.91	7.2	68.6	12,455	1,647	-0.05%	1,926	-159	-1,767	-1,744	-23
현대차	196,500	2.61	171.8	65.2	56,311	7,273	-0.05%	-1,479	3,645	-2,814	-5,552	-378
LG 화학	559,000	-0.53	61.2	64.8	11,469	1,433	0.03%	210	1,323	-1,558	-927	-555
SK 하이닉스	99,900	-0.10	137.4	63.1	195,190	-3,902	-0.09%	1,741	-2,733	1,148	-2,315	4,410
삼성 SDI	560,000	-1.41	58.7	60.3	17,312	-76	0.00%	263	-241	-51	-68	149

자료: KBX 유아티즈권 리서치센터