

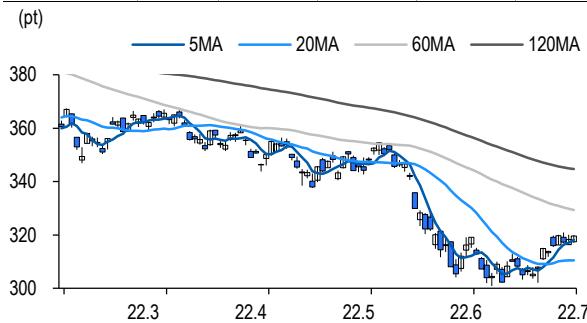


선물옵션시장 지표

2022.7.27

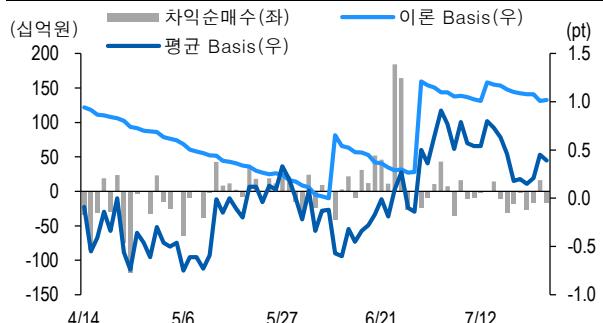
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	319.61	0.40	1.27	3,865.6	-
선물 9월물	320.50	0.44	1.40	16,624.7	292,943
선물 12월물	321.50	0.44	1.40	30.1	19,829
8월물(mini)	320.22	0.46	1.46	1,180.7	64,080
9월물(mini)	320.40	0.41	1.46	9.6	7,309



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.98	0.39	0.89	-0.18%
베이시스(mini)	0.34	0.11	0.61	-0.07%
제1스프레드(SP)	1.34	1.02	1.00	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.34	0.62	0.62	0.09%



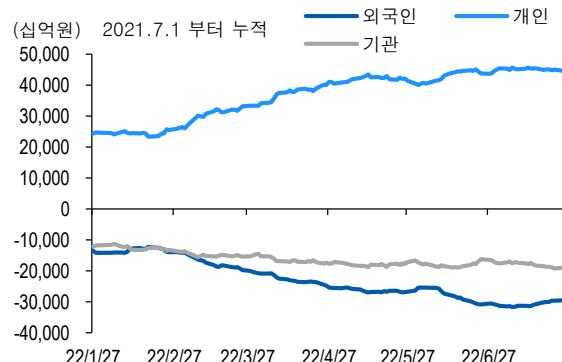
투자주체별 매매 동향

(십억원)

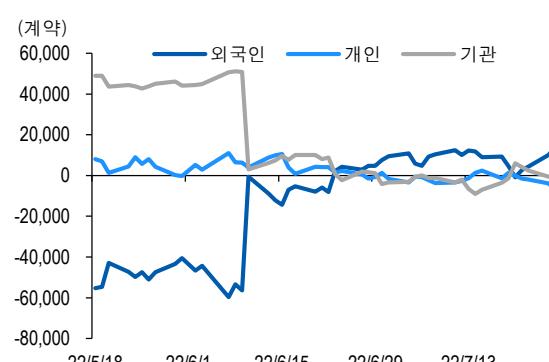
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	2.2	12.3	14.5	1.1	55.4	288.0	5.4	1.4	-0.8	4.5
개인	-47.6	41.6	-6.0	0.0	-0.8	-250.1	-8.2	0.4	-0.2	-10.3
기관	45.9	-57.3	-11.4	-1.6	-36.0	-30.9	7.4	-1.8	1.6	7.0
금융투자	55.0	-60.7	-5.8	0.0	1.0	-46.1	7.1	-1.1	1.6	-13.3
투신	-2.5	4.5	2.0	0.0	-6.6	-26.6	0.1	0.0	0.0	11.9
은행+보험+기타금융	8.4	-3.7	4.7	0.0	-9.9	31.7	0.1	-0.7	0.0	-2.3
연기금+국가지자체	-10.2	4.7	-5.5	-1.6	-15.1	10.1	0.0	0.0	0.0	10.7
기타법인	-0.6	3.5	2.9	0.0	-1.0	-7.0	-4.6	-0.1	-0.7	-1.2

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	526,735	167.2	886,267	17.4%	지수옵션 전체	1,156,884	332.2	2,238,810
Put	630,149	165.0	1,352,543	18.8%	PCR(금액기준)	0.99	VKOSPI	19.38%(-0.59%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	325.0(K+3)	2.71	0.25	48,455	25,724	-435	17.3	Put
	322.5(K+2)	3.77	0.37	19,677	16,843	732	17.8	
	320.0(K+1)	5.03	0.48	14,977	16,756	-150	18.3	
	317.5(K+0)	6.47	0.57	4,543	9,985	-297	18.7	
	315.0(K-1)	8.14	0.69	4,179	13,294	-267	19.3	

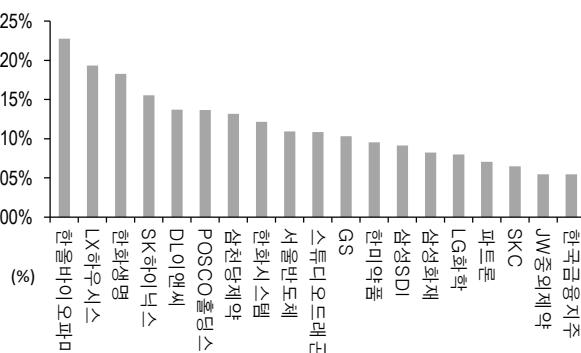
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	1,876,469	1,379.4	3,901,222	11,737	-23,591	-3,439	27,019	4.5	-10.3	7.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
BGF	4,170	-2.11	0.2	89.3	3,400	-375	-0.19%	-1,003	53	950
삼성전자	61,800	0.98	330.0	81.4	1,163,267	-23,143	-0.07%	94	-10,512	10,418
삼성전기	143,000	0.00	31.3	78.9	27,744	-1,251	-0.07%	-1,074	681	393
현대차	196,000	-0.25	111.9	78.3	55,872	-439	-0.04%	706	880	-1,586
SK 하이닉스	100,500	0.60	113.4	69.4	194,225	-965	0.16%	9,968	-6,671	-3,244
삼성 SDI	564,000	0.71	43.1	59.0	17,175	-137	0.09%	878	119	-994
대한항공	25,150	0.20	6.2	53.2	46,333	-1,374	0.05%	3,413	253	-3,666
LG 이노텍	350,500	1.74	21.8	52.2	8,077	73	-0.06%	652	-52	-600
현대위아	61,000	-0.49	6.2	52.2	5,596	1,347	-0.05%	-1,818	525	1,282
KB 금융	47,650	-0.52	11.7	50.3	39,014	-573	-0.04%	-779	72	707

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터