

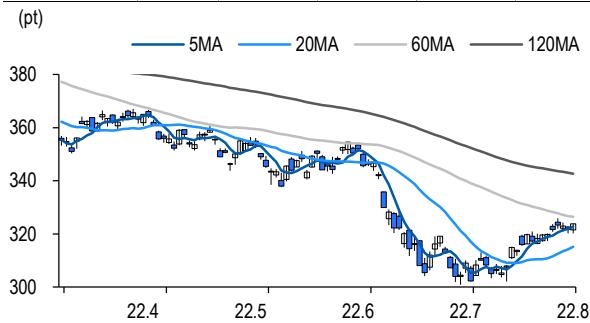


## 선물옵션시장 지표

2022.8.4

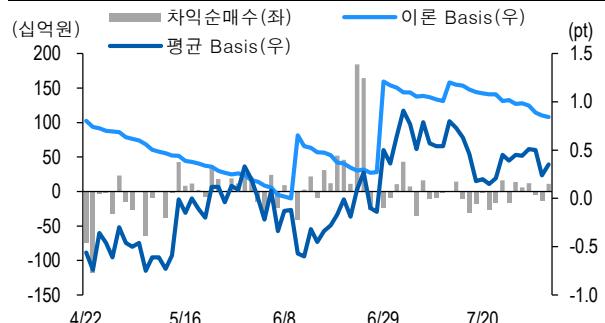
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	323.80	0.67	2.16	4,894.6	-
선물 9월물	324.15	0.82	2.65	18,167.0	304,817
선물 12월물	325.10	0.77	2.50	26.1	20,128
8월물(mini)	323.90	0.83	2.68	1,302.5	70,996
9월물(mini)	324.12	0.81	2.32	7.1	7,961



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.84	0.35	0.35	-0.15%
베이시스(mini)	0.16	0.04	0.10	-0.04%
제1스프레드(SP)	1.49	1.06	1.00	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.16	0.05	0.05	-0.04%



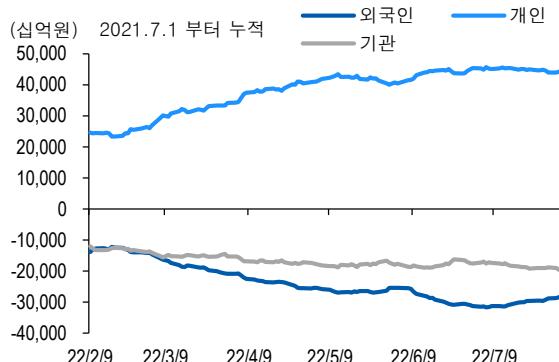
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

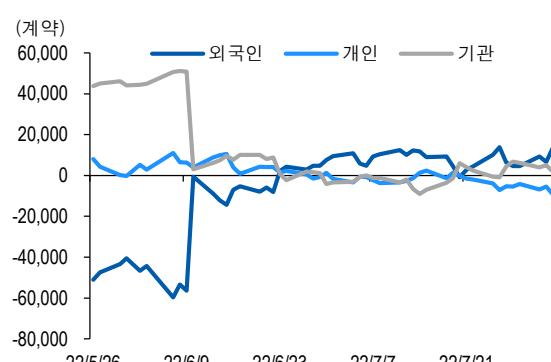
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	473.5	34.9	508.5	0.4	403.9	525.4	53.2	-1.2	-2.5	4.3
개인	-332.2	37.8	-294.4	0.0	-0.9	-284.2	-29.9	-0.7	2.1	9.7
기관	-144.3	-76.6	-221.0	10.9	-38.9	-234.4	-21.0	2.4	0.7	-13.6
금융투자	-35.3	-22.6	-57.9	-0.4	0.3	-480.7	-18.9	1.3	0.7	-7.7
투신	-47.6	-23.6	-71.3	0.0	-24.7	265.5	-2.0	0.1	0.0	11.6
은행+보험+기타금융	-8.0	-17.3	-25.2	0.0	-24.8	-12.5	-0.1	0.9	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-3.9	7.4	3.5	11.3	7.4	-6.7	0.0	0.0	0.0	-17.5
기타법인	3.0	3.9	6.9	0.0	0.8	-6.8	-2.3	-0.5	-0.2	-0.4

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	749,860	174.8	937,339	14.7%	지수옵션 전체	1,516,234	330.2	2,520,829							
Put	766,374	155.4	1,583,490	18.4%	PCR(금액기준)	0.89	VKOSPI	18.45%(-0.79%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	330.0(K+3)	0.88	0.20	169,338	32,473	506	14.4	Put	325.0(K+1)	3.82	-1.99	7,021	9,338	1,141	16.3
	327.5(K+2)	1.63	0.39	105,359	21,624	-33	15.0		322.5(K+0)	2.71	-1.65	19,623	10,059	2,055	16.9
	325.0(K+1)	2.69	0.64	77,709	22,288	462	15.5		320.0(K-1)	1.87	-1.39	39,128	14,873	1,054	17.5
	322.5(K+0)	4.06	0.94	30,085	16,842	-441	16.0		317.5(K-2)	1.28	-1.08	52,210	14,214	2,904	18.2
	320.0(K-1)	5.73	1.24	12,180	17,064	-493	16.6		315.0(K-3)	0.86	-0.83	85,733	22,700	3,199	18.9

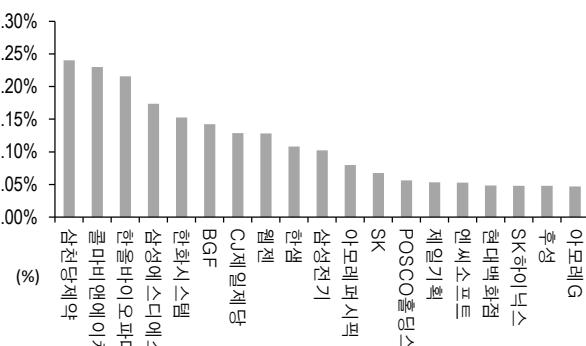
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	2,407,148	1,707.8	4,037,065	25,991	5,376	8,166	-13,750	4.3	9.7	-13.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	61,400	-0.32	534.4	87.4	1,079,409	-4,178	0.05%	-16,402	-6,519	22,621
BGF	4,210	0.24	0.3	81.2	3,463	283	0.14%	1,106	2	-1,108
LG 생활건강	765,000	0.00	21.1	66.4	1,371	-633	-0.10%	225	183	-408
현대차	197,500	0.25	81.5	60.8	55,027	2,457	0.03%	-557	1,326	-759
넥센타이어	6,520	3.99	1.3	56.8	5,550	-1,586	-0.12%	2,378	42	-2,420
일진머티리얼즈	75,200	1.35	7.7	54.3	49,010	321	-0.03%	1,855	-667	-1,188
현대엘리베이	28,600	0.53	1.2	53.7	3,148	-280	-0.12%	-298	19	279
삼성전기	140,500	-0.71	33.6	53.3	32,862	432	0.10%	-3,233	4,269	-1,036
KB 금융	47,700	0.32	14.8	51.1	27,927	-772	0.00%	1,223	-295	-928
호텔신라	71,500	0.56	4.4	50.9	13,374	956	-0.02%	1,157	-105	-1,052

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터