

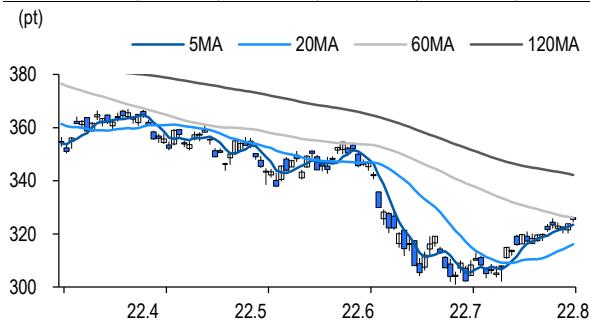


선물옵션시장 지표

2022.8.5

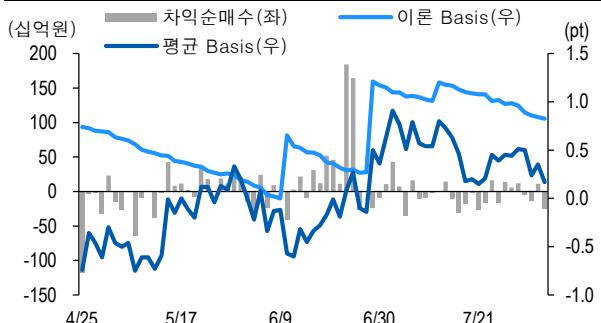
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	325.47	0.52	1.67	5,582.3	-
선물 9월물	325.75	0.49	1.60	19,865.4	304,539
선물 12월물	326.85	0.54	1.75	27.6	20,174
8월물(mini)	325.50	0.49	1.60	1,666.2	76,434
9월물(mini)	325.60	0.44	1.48	5.9	8,176



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.83	0.17	0.28	-0.20%
베이시스(mini)	0.14	-0.06	0.03	-0.06%
제1스프레드(SP)	1.50	1.09	1.10	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.14	0.04	0.04	-0.03%



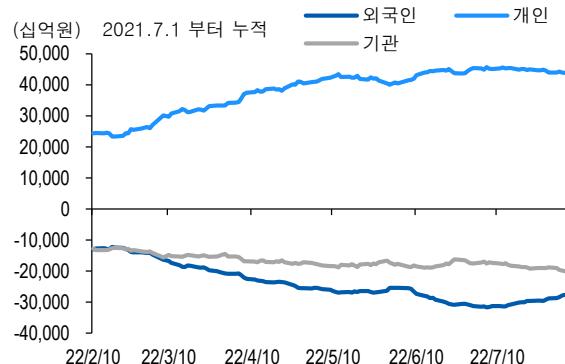
투자주체별 매매 동향

(십억원)

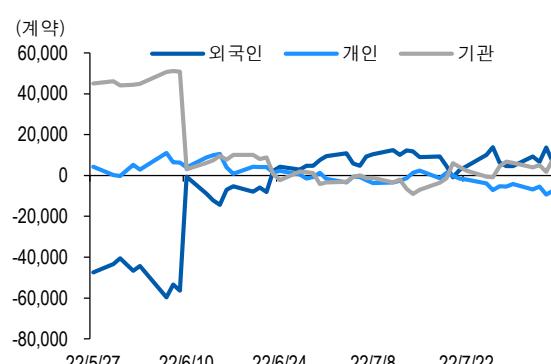
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	197.4	7.3	204.7	-1.8	209.2	-547.5	-51.2	1.1	-4.7	-26.7
개인	12.0	-82.0	-70.0	0.0	-4.9	158.0	-4.5	1.7	-0.9	-24.6
기관	-226.5	53.2	-173.3	-23.4	17.0	451.7	56.5	-2.5	6.0	50.7
금융투자	-209.9	61.6	-148.3	-2.2	-7.1	480.4	56.5	-2.8	6.0	21.1
투신	0.4	4.5	4.9	0.0	0.9	-132.7	0.0	0.2	0.1	6.4
은행+보험+기타금융	6.7	-6.0	0.7	-1.6	5.1	35.1	0.0	0.0	-0.1	0.1
연기금+국가지자체	33.2	4.3	37.5	-19.5	19.3	68.9	0.0	0.0	0.0	23.1
기타법인	17.1	21.5	38.6	0.0	-0.4	-62.1	-0.8	-0.2	-0.4	0.5

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	802,240	205.5	963,910	13.4%	지수옵션 전체	1,760,619	394.9	2,594,664							
Put	958,379	189.4	1,630,754	16.6%	PCR(금액기준)	0.92	VKOSPI	17.70%(-0.75%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	332.5(K+3)	0.46	0.03	183,654	27,733	-1,397	13.1	Put	327.5(K+1)	3.89	-1.36	14,448	4,214	2,211	14.9
	330.0(K+2)	0.99	0.11	167,348	34,075	1,602	13.4		325.0(K+0)	2.62	-1.20	47,689	13,690	4,352	15.3
	327.5(K+1)	1.85	0.22	108,381	19,216	-2,408	13.8		322.5(K-1)	1.72	-0.99	78,912	12,681	2,622	15.9
	325.0(K+0)	3.13	0.44	49,659	23,188	900	14.5		320.0(K-2)	1.10	-0.77	109,050	20,285	5,412	16.6
	322.5(K-1)	4.70	0.64	13,511	17,081	239	14.9		317.5(K-3)	0.67	-0.61	105,606	16,439	2,225	17.1

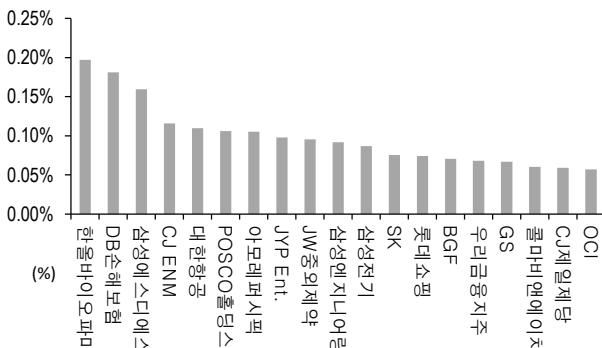
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,436,846	1,716.0	4,061,245	24,180	-26,864	-14,777	41,229	-26.7	-24.6	50.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	61,500	0.16	422.7	75.3	1,058,628	-20,781	-0.04%	-6,353	-19,144	25,597
현대차	197,000	-0.25	78.1	64.3	54,720	-307	0.01%	-105	49	36
삼성전기	141,000	0.36	27.1	61.4	32,023	-839	0.09%	1,953	-1,598	-355
넥센타이어	6,540	0.31	0.5	58.8	5,832	282	-0.24%	-1,075	-699	1,774
LG 이노텍	351,500	-1.13	24.4	48.8	7,001	-548	0.00%	-346	233	120
BGF	4,410	4.75	0.2	43.6	2,890	-573	0.07%	-717	-340	1,057
LG 디스플레이	16,000	3.90	11.3	43.6	70,339	491	-0.19%	10,768	515	-11,283
NAVER	273,000	1.30	112.8	43.1	33,539	-931	-0.03%	-260	-929	1,095
삼성 SDI	587,000	0.51	49.5	41.5	14,883	272	-0.13%	-732	547	185
호텔신라	72,600	1.54	5.6	41.3	13,272	-102	-0.10%	-180	-41	221

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터