

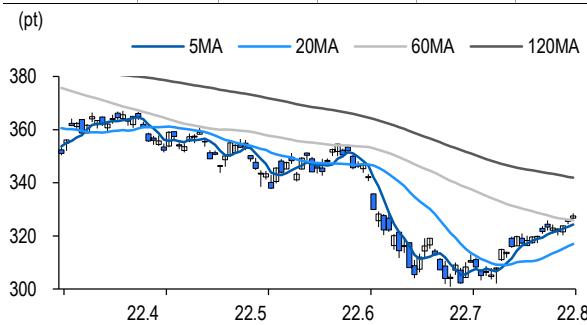


## 선물옵션시장 지표

2022.8.8

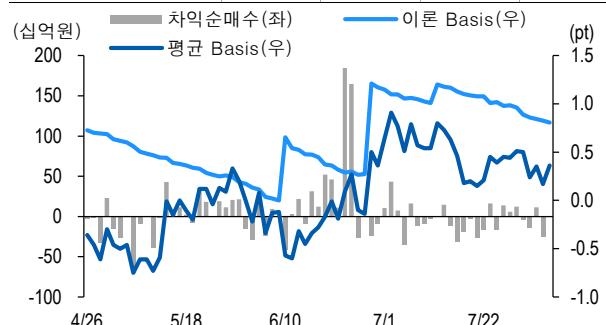
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	327.50	0.62	2.03	5,741.0	-
선물 9월물	327.35	0.49	1.60	16,232.8	308,722
선물 12월물	328.65	0.55	1.80	25.1	20,215
8월물(mini)	327.18	0.52	1.68	1,186.3	71,986
9월물(mini)	327.52	0.54	1.92	8.7	8,282



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.81	0.36	-0.15	-0.14%
베이시스(mini)	0.12	0.01	-0.32	-0.03%
제1스프레드(SP)	1.52	1.12	1.15	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	0.12	-0.23	-0.23	-0.11%



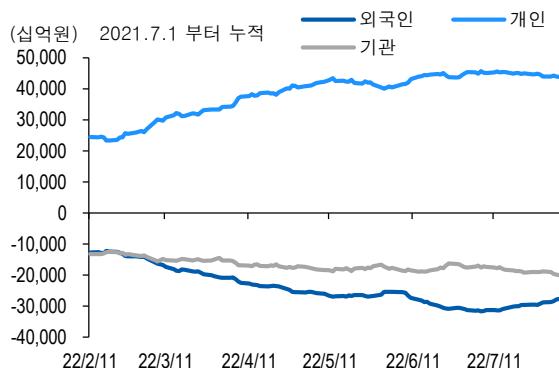
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

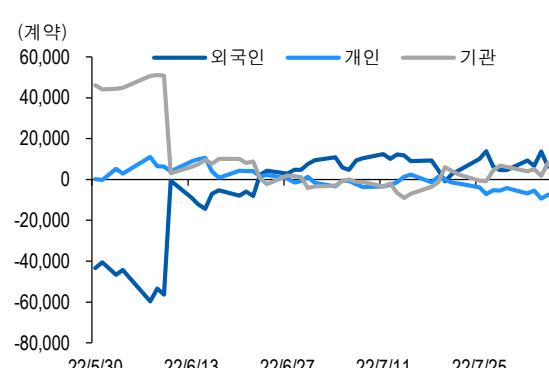
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	373.4	9.6	383.0	1.2	375.9	173.4	-38.4	-6.0	-0.2	23.0
개인	-417.0	-152.8	-569.8	0.0	-1.3	5.0	4.7	4.5	-1.8	-2.2
기관	45.9	143.7	189.6	-1.7	5.8	-204.9	29.9	1.4	2.3	-20.2
금융투자	100.5	146.3	246.8	0.0	1.4	-262.3	29.9	0.3	2.4	-17.4
투신	-22.9	2.9	-20.1	0.0	-17.3	26.6	0.0	0.8	0.0	16.4
은행+보험+기타금융	4.6	-14.9	-10.3	0.0	4.2	64.3	0.0	0.0	0.0	-0.1
연기금+국가지자체	-9.3	5.3	-4.0	-1.7	18.4	-33.6	0.0	0.3	-0.1	-19.2
기타법인	-2.3	-0.4	-2.8	0.0	-0.1	26.5	3.8	0.1	-0.3	-0.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	995,975	261.1	993,984	12.4%	지수옵션 전체	2,184,566	462.9	2,711,910
Put	1,188,591	201.8	1,717,926	16.1%	PCR(금액기준)	0.77	VKOSPI	17.00%(-0.70%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	332.5(K+3)	0.62	0.16	230,341	26,712	-1,021	12.4	327.5(K+1)
	330.0(K+2)	1.29	0.30	197,719	31,855	-2,220	12.5	325.0(K+0)
	327.5(K+1)	2.38	0.53	107,246	18,854	-362	12.7	322.5(K-1)
	325.0(K+0)	3.90	0.77	30,839	24,005	817	12.9	320.0(K-2)
	322.5(K-1)	5.66	0.96	6,996	16,738	-343	12.0	317.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	327.5(K+1)	2.65	-1.24	61,671	11,044	6,830	15.1	327.5(K+1)
	325.0(K+0)	1.63	-0.99	115,558	18,200	4,510	15.3	325.0(K+0)
	322.5(K-1)	0.95	-0.77	146,631	19,364	6,683	15.7	322.5(K-1)
	320.0(K-2)	0.52	-0.58	169,083	27,336	7,051	16.0	320.0(K-2)
	317.5(K-3)	0.30	-0.37	124,604	21,596	5,157	16.8	317.5(K-3)

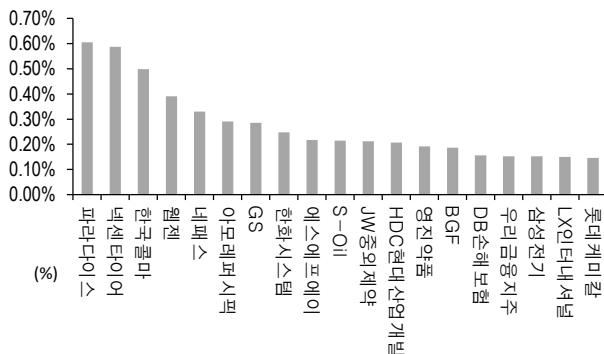
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	2,644,841	1,861.9	4,124,330	63,085	25,154	-31,140	6,745	23.0	-2.2	-20.2
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
삼성전자	61,600	0.16	432.5	74.0	1,047,250	-11,378	-0.02%	14,298	-11,937	-2,361
현대차	194,500	-1.27	120.4	67.4	54,776	56	0.00%	785	481	-1,270
삼성전기	141,500	0.35	33.5	64.0	31,911	-112	0.15%	-248	1,042	-903
KT	37,950	0.93	11.9	58.8	44,776	-677	-0.20%	-646	-6,214	6,860
일진미터리얼즈	76,200	-0.13	13.8	55.2	50,128	613	-0.02%	-1,515	993	522
넥센타이어	6,640	1.53	0.6	48.9	5,436	-396	0.59%	398	-722	324
현대건설	42,150	0.96	5.5	48.3	13,104	-1,106	-0.08%	-304	-492	796
엔씨소프트	387,000	0.39	17.2	47.2	8,102	-109	0.01%	-154	-276	430
LG 전자	96,100	0.00	18.9	44.3	22,547	-1,298	0.00%	-648	-1,407	2,055
아모레퍼시픽	129,500	1.57	11.5	43.5	12,469	-1,504	0.29%	1,999	402	-2,403

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터