

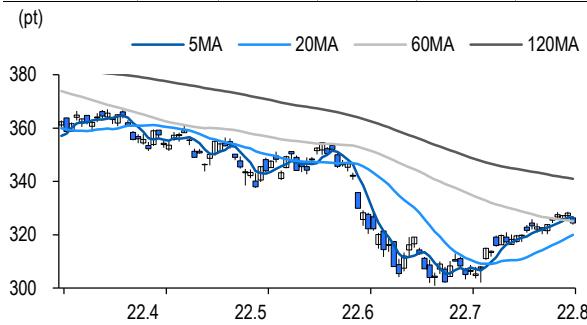


## 선물옵션시장 지표

2022.8.11

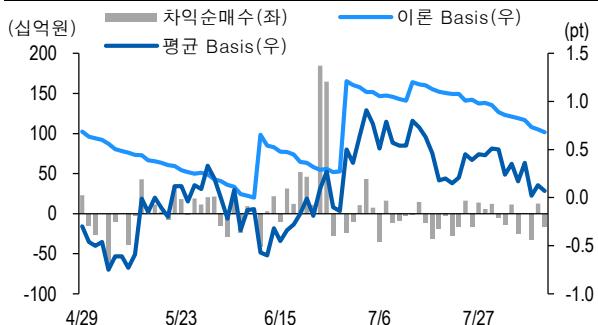
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	324.35	-1.15	-3.76	6,118.7	-
선물 9월물	324.50	-1.13	-3.70	15,424.6	314,238
선물 12월물	325.60	-1.15	-3.80	22.9	20,398
8월물(mini)	324.32	-1.12	-3.68	1,408.1	78,775
9월물(mini)	324.48	-1.13	-3.70	51.6	12,817



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.68	0.07	0.15	-0.19%
베이시스(mini)	-0.01	-0.05	-0.03	-0.01%
제1스프레드(SP)	1.52	1.20	1.20	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.01	-0.05	-0.05	-0.01%



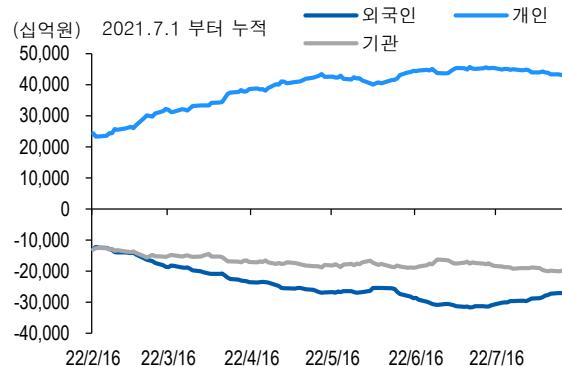
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

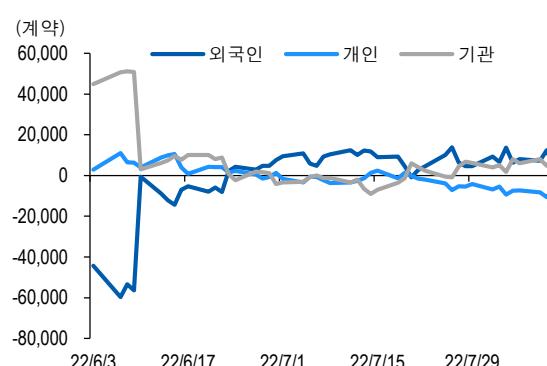
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-102.2	27.4	-74.8	-0.6	-85.4	-677.9	2.0	-2.6	0.1	6.5
개인	262.0	22.9	284.9	0.0	-1.3	343.0	4.2	2.1	-0.7	5.3
기관	-203.2	-56.3	-259.5	-15.4	-18.7	359.5	-4.5	0.8	0.8	-14.4
금융투자	-69.5	-56.0	-125.6	-0.7	-5.0	741.3	-7.6	0.3	-1.5	-22.8
투신	-46.2	1.9	-44.3	0.0	-19.4	-445.9	-1.1	0.7	0.0	-22.4
은행+보험+기타금융	-7.1	-15.1	-22.2	0.0	-4.9	-1.3	4.2	0.0	1.8	-0.2
연기금+국가지자체	-56.9	9.8	-47.1	-14.7	17.0	65.4	0.0	-0.2	0.4	31.0
기타법인	43.4	6.1	49.5	0.0	1.0	-24.6	-1.7	-0.3	-0.1	2.6

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	1,305,561	205.9	1,085,603	15.1%	지수옵션 전체	2,608,596	465.0	2,953,667
Put	1,303,035	259.1	1,868,064	16.7%	PCR(금액기준)	1.26	VKOSPI	17.18%(+0.68%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	335.0(K+3)	0.02	-0.07	53,135	40,149	-1,080	19.3	330.0(K+1)
	332.5(K+2)	0.03	-0.26	145,889	35,794	1,219	16.3	327.5(K+0)
	330.0(K+1)	0.07	-0.76	339,986	45,151	11,455	14.0	325.0(K-1)
	327.5(K+0)	0.34	-1.60	391,133	33,979	13,150	14.2	322.5(K-2)
	325.0(K-1)	1.22	-2.41	204,566	28,368	5,822	15.7	320.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	330.0(K+1)	5.72	2.91	9,641	8,075	468	15.7	330.0(K+3)
	327.5(K+0)	3.54	2.09	82,223	15,202	-703	15.7	332.5(K+2)
	325.0(K-1)	1.87	1.24	223,531	22,329	-5,384	16.2	330.0(K+1)
	322.5(K-2)	0.82	0.57	365,039	24,479	-3,524	16.7	327.5(K+0)
	320.0(K-3)	0.29	0.18	311,417	41,409	2,964	17.1	325.0(K-1)

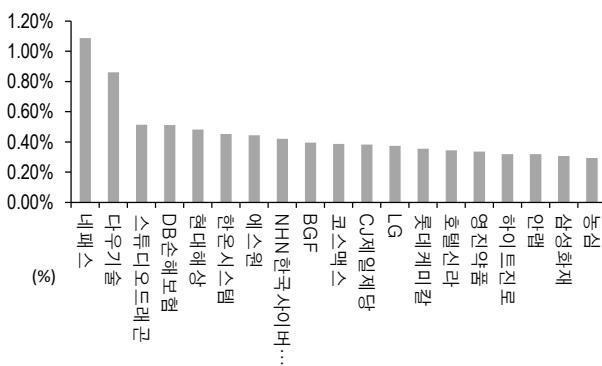
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	3,557,134	2,512.5	4,501,135	221,404	29,487	43,540	-74,553	6.5	5.3	-14.4
<hr/>										
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	192,000	-1.03	55.3	56.6	38,048	-3,928	0.03%	-2,102	513	1,589
NAVER	261,500	-1.51	43.4	52.2	13,167	-16,648	0.03%	-2,492	-2,085	4,578
삼성전자	59,200	-1.33	512.6	48.5	524,539	-67,417	-0.07%	20,329	7,303	-27,702
LG 화학	647,000	-3.58	67.8	47.1	4,722	-985	-0.08%	960	-933	-21
현대건설	46,450	8.28	66.1	44.2	36,666	26,812	0.08%	12,402	1,119	-13,521
삼성생명	62,100	-0.64	3.4	41.3	6,719	-2,096	-0.20%	-958	42	916
LG 디스플레이	15,800	-0.94	6.1	40.8	41,180	-9,742	0.06%	205	-2,291	2,086
POSCO 흘딩스	248,500	1.22	31.2	40.5	16,182	-3,213	-0.05%	-392	-1,992	2,124
SK	224,000	1.36	16.4	40.4	5,473	-2,443	0.08%	-807	2,586	-1,779
일진마티리얼즈	74,600	-0.53	6.7	40.2	30,308	-4,168	0.02%	-90	-665	755

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터