

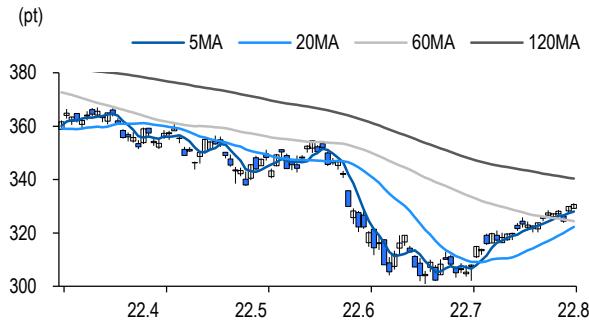


## 선물옵션시장 지표

2022.8.15

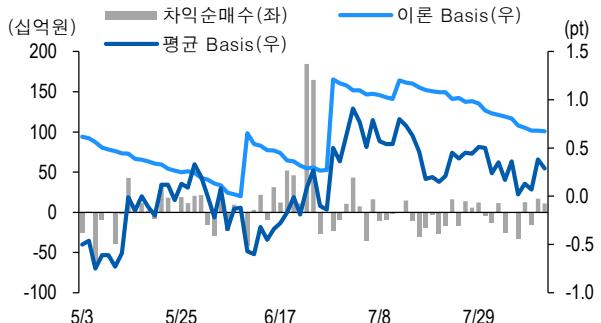
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	330.67	0.23	0.75	6,123.2	-
선물 9월물	330.70	0.15	0.50	14,730.3	293,889
선물 12월물	331.80	0.15	0.50	95.6	20,522
9월물(mini)	330.70	0.15	0.58	1,175.8	32,294
10월물(mini)	330.54	0.25	0.84	3.2	1,958



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.68	0.29	0.03	-0.12%
베이시스(mini)	0.68	0.29	0.03	-0.12%
제1스프레드(SP)	1.57	-	1.20	-
합성선물 베이시스(ATM)	0.68	0.07	0.07	-0.18%



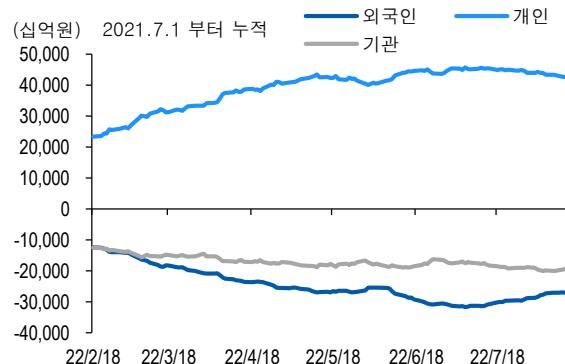
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

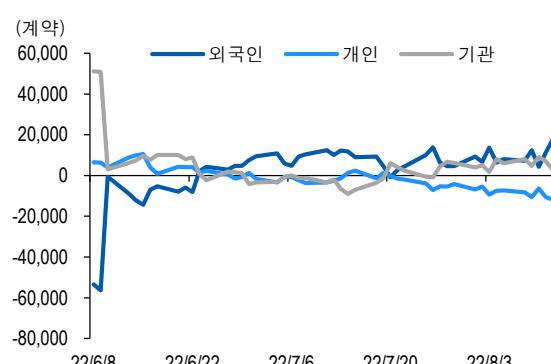
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-13.0	-40.9	-53.9	3.8	45.0	416.3	-5.3	0.1	-3.0	16.2
개인	-224.4	65.7	-158.8	0.0	3.3	-111.6	-7.7	-1.8	-1.2	29.9
기관	202.8	-19.8	183.0	7.3	-5.4	-208.1	14.5	1.6	4.6	-48.3
금융투자	176.1	-21.7	154.4	2.3	3.5	-124.2	14.6	1.6	4.8	1.4
투신	21.1	1.1	22.2	0.0	7.9	-105.3	0.0	0.0	-0.1	-4.0
은행+보험+기타금융	-9.2	-7.9	-17.0	0.0	-2.5	26.9	0.0	0.0	-0.1	0.1
연기금+국가지자체	61.2	6.0	67.2	4.9	-14.8	-5.5	0.0	0.0	0.0	-45.8
기타법인	34.6	-4.9	29.7	0.0	0.1	-96.7	-1.4	0.1	-0.4	2.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

## 지수옵션 시장동향

								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	384,835	137.2	636,737	12.6%	지수옵션 전체		891,758	285.9	1,667,099		
Put	506,923	148.7	1,030,362	15.8%	PCR(금액기준)		1.08	VKOSPI	15.45%(-0.29%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	337.5(K+3)	2.23	0.03	41,726	9,922	1,808	12.6	332.5(K+1)	5.99	-0.47	2,264
	335.0(K+2)	3.11	0.05	30,075	11,134	1,123	12.8	330.0(K+0)	4.77	-0.46	10,184
	332.5(K+1)	4.22	0.09	10,644	9,400	4,051	13.0	327.5(K-1)	3.82	-0.37	7,307
	330.0(K+0)	5.51	0.13	9,507	11,491	1,111	13.2	325.0(K-2)	3.02	-0.30	19,522
	327.5(K-1)	7.03	0.17	2,391	2,262	-5	13.4	322.5(K-3)	2.36	-0.27	26,314

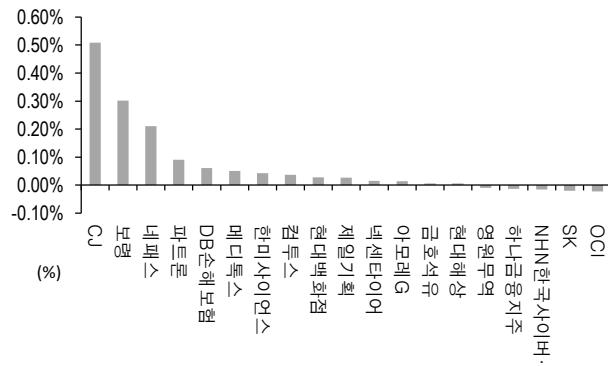
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

## 역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

## 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

## 주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	금융투자	연기금등	순매수
주식선물 전체	2,950,397	1,855.1	3,526,561	298,064	30,147	68,653	-102,087	16.2	29.9	-48.3			
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인	개인	기관	금융투자	연기금등	순매수
넥센타이어	6,670	1.06	0.7	108.9	4,704	1,887	0.01%	244	-1,039	795	630	165	
호텔신라	72,300	-0.82	10.1	84.8	11,858	6,373	-0.26%	2,089	451	-2,539	-2,783	244	
삼성전자	60,100	0.50	510.6	78.9	1,018,030	15,787	-0.18%	10,929	-32,727	21,633	13,398	150	
LG 전자	102,000	0.99	86.0	74.1	34,401	2,617	-0.07%	-1,262	1,595	-355	808	-1,663	
일진미터리얼즈	77,300	2.52	14.5	68.9	49,147	4,190	-0.03%	-68	3,820	-3,749	-2,930	-819	
현대차	197,000	1.55	78.2	63.9	45,580	6,201	-0.03%	1,404	3,770	-5,374	-1,943	-3,861	
메리츠증권	4,920	0.20	1.0	61.5	21,102	-2,020	-0.41%	-1,976	-1,152	3,128	3,128	0	
BGF	4,250	-0.93	0.1	54.7	1,176	199	-0.58%	191	42	-233	-233	0	
한국조선해양	93,600	-0.43	6.4	45.9	5,162	652	-0.16%	-1,174	341	833	111	722	
SK 하이닉스	93,500	0.43	79.4	44.5	194,249	14,879	-0.05%	-1,714	4,934	-3,086	-3,267	210	

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터