

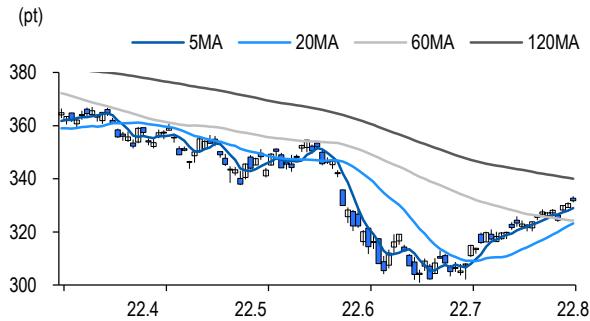


선물옵션시장 지표

2022.8.17

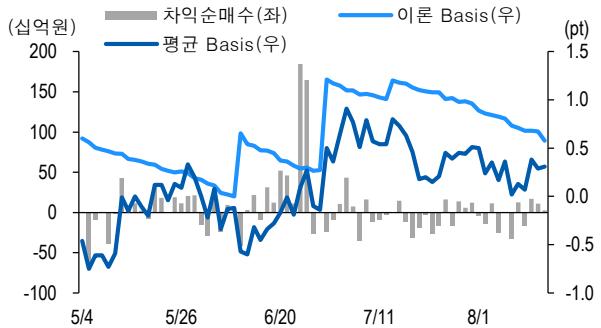
Market Data (십억원, 계약)

| | 종가(pt) | 등락률(%) | 등락폭(pt) | 거래대금 | 미결제 |
|------------|--------|--------|---------|----------|---------|
| KOSPI200 | 331.78 | 0.34 | 1.11 | 6,133.3 | - |
| 선물 9월물 | 332.05 | 0.41 | 1.35 | 13,698.0 | 295,326 |
| 선물 12월물 | 333.20 | 0.42 | 1.40 | 111.5 | 20,183 |
| 9월물(mini) | 332.06 | 0.41 | 1.36 | 1,035.3 | 35,128 |
| 10월물(mini) | 331.88 | 0.41 | 1.34 | 1.8 | 3,808 |



차익거래 관련 Market data (pt)

| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) |
|----------------|------|------|------|--------|
| K200 베이시스 | 0.58 | 0.31 | 0.27 | -0.08% |
| 베이시스(mini) | 0.58 | 0.31 | 0.28 | -0.08% |
| 제1스프레드(SP) | 1.58 | 1.18 | 1.15 | -0.12% |
| 합성선물 베이시스(ATM) | 0.58 | 0.25 | 0.25 | -0.10% |



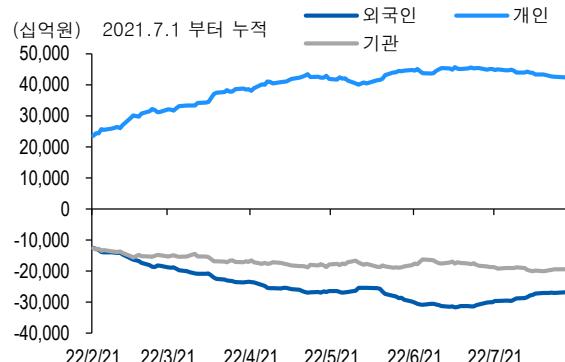
투자주체별 매매 동향

(십억원)

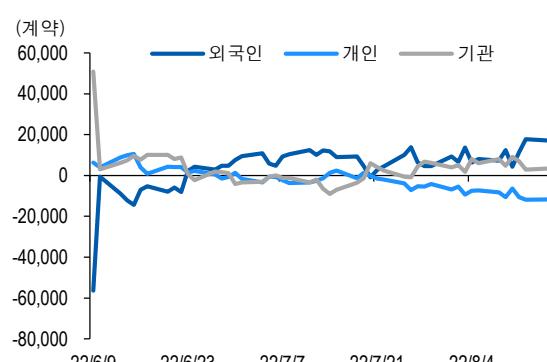
| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 |
|------------|-------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|
| 외국인 | 56.7 | 76.7 | 133.4 | 3.3 | -115.1 | -48.3 | -23.7 | 0.0 | -1.2 | -24.2 |
| 개인 | -53.4 | -95.4 | -148.7 | 0.0 | 0.4 | 12.3 | 0.9 | -0.7 | -2.3 | 94.7 |
| 기관 | -24.9 | 40.5 | 15.7 | -0.4 | -22.2 | 37.9 | 18.4 | 0.8 | 3.6 | -69.4 |
| 금융투자 | 42.2 | 90.7 | 132.8 | -0.4 | -0.5 | 223.3 | 19.9 | 0.7 | 3.6 | -43.7 |
| 투신 | -25.0 | -3.4 | -28.3 | 0.0 | -14.1 | -163.8 | -1.7 | 0.1 | 0.0 | 9.0 |
| 은행+보험+기타금융 | -14.0 | -56.3 | -70.3 | 0.0 | -3.5 | 3.1 | 0.2 | 0.0 | 0.0 | 0.7 |
| 연기금+국가지자체 | -9.5 | 0.5 | -9.0 | 0.0 | -1.7 | -24.7 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -35.3 |
| 기타법인 | 21.6 | -21.9 | -0.3 | 0.0 | -1.5 | -1.8 | 4.4 | -0.1 | -0.2 | -1.2 |

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 | 450,130 | 139.4 | 677,208 | 12.8% | 지수옵션 전체 | 967,984 | 271.6 | 1,784,135 | | | | | | | |
| Put | 517,854 | 132.2 | 1,106,927 | 15.5% | PCR(금액기준) | 0.95 | VKOSPI | 15.42%(-0.03%p) | | | | | | | |
| | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | | | | | | | | |
| Call | 337.5(K+3) | 2.30 | 0.07 | 35,791 | 11,637 | 1,715 | 12.8 | Put | 332.5(K+1) | 4.93 | -1.06 | 7,849 | 2,652 | 1,647 | 14.4 |
| | 335.0(K+2) | 3.26 | 0.15 | 21,404 | 11,601 | 467 | 13.0 | | 330.0(K+0) | 3.89 | -0.88 | 16,212 | 15,705 | 1,405 | 14.8 |
| | 332.5(K+1) | 4.46 | 0.24 | 7,982 | 10,470 | 1,070 | 13.3 | | 327.5(K-1) | 3.00 | -0.82 | 15,784 | 5,654 | 1,295 | 15.0 |
| | 330.0(K+0) | 5.92 | 0.41 | 4,633 | 11,686 | 195 | 13.7 | | 325.0(K-2) | 2.31 | -0.71 | 29,338 | 11,665 | 1,472 | 15.4 |
| | 327.5(K-1) | 7.55 | 0.52 | 2,503 | 2,295 | 33 | 14.0 | | 322.5(K-3) | 1.78 | -0.58 | 34,109 | 11,006 | 1,944 | 15.9 |

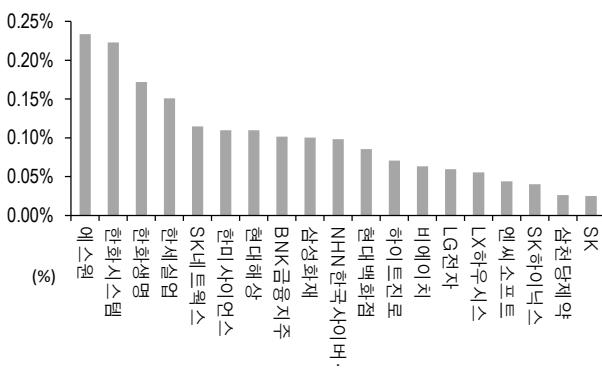
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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 | 3,054,275 | 2,112.1 | 3,622,615 | 96,054 | -63,440 | 119,496 | -55,698 | -24.2 | 94.7 | -69.4 |
| 종목명 | 선물현재가(원) | 등락률(%) | 선물거래대금(십억원) | 선현배율(%) | 미결제수량(계약) | 미결제증감(계약) | 평균괴리율(%) | 외국인순매수 | 개인순매수 | 기관순매수 |
| 삼성전자 | 60,900 | 1.33 | 676.7 | 78.7 | 1,024,968 | 6,938 | -0.06% | -6,806 | 59,652 | -53,087 |
| 넥센타이어 | 6,700 | 0.45 | 0.9 | 74.7 | 4,087 | -617 | -0.13% | 1,005 | 210 | -1,215 |
| SK 하이닉스 | 96,700 | 3.42 | 286.5 | 72.3 | 176,676 | -17,573 | 0.04% | -10,111 | 30,542 | -20,258 |
| LG 화학 | 662,000 | -0.60 | 62.3 | 65.9 | 8,881 | 252 | -0.08% | -317 | 442 | -124 |
| 한국조선해양 | 92,900 | -0.75 | 7.7 | 65.2 | 5,620 | 458 | -0.11% | -431 | 383 | 48 |
| 현대차 | 198,000 | 0.51 | 59.6 | 59.9 | 46,354 | 774 | -0.10% | -2,243 | 1,855 | 495 |
| 일진머티리얼즈 | 77,800 | 0.65 | 12.6 | 52.2 | 50,718 | 1,571 | -0.02% | 302 | 1,168 | -1,458 |
| LG 전자 | 102,500 | 0.49 | 43.8 | 49.5 | 38,304 | 3,903 | 0.06% | 2,439 | -130 | -2,309 |
| 호텔신라 | 72,900 | 0.83 | 4.4 | 49.1 | 12,358 | 500 | -0.14% | 262 | 486 | -748 |
| 삼성전기 | 138,000 | 0.36 | 24.9 | 47.6 | 29,795 | 825 | 0.02% | 788 | 712 | -1,391 |

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터