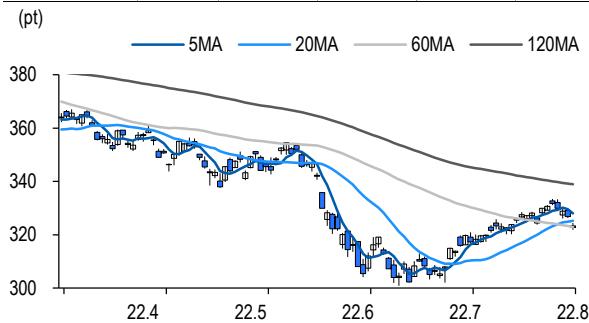


선물옵션시장 지표

2022.8.23

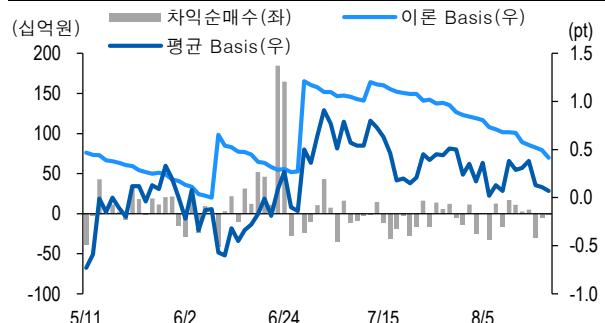
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	322.77	-1.23	-4.02	4,261.2	-
선물 9월물	322.20	-1.41	-4.60	16,374.4	297,284
선물 12월물	323.45	-1.40	-4.60	183.2	20,841
9월물(mini)	322.26	-1.39	-4.52	1,209.4	44,174
10월물(mini)	322.52	-1.32	-4.32	8.3	9,350



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.41	0.07	-0.57	-0.11%
베이시스(mini)	0.41	0.07	-0.51	-0.11%
제1스프레드(SP)	1.51	1.20	1.20	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.41	-0.54	-0.54	-0.30%



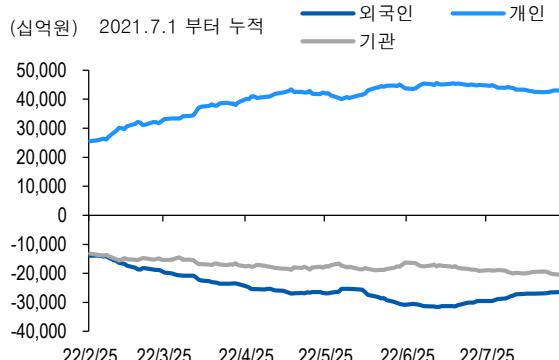
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	119.1	6.6	125.7	-4.2	121.6	194.1	3.7	-0.2	2.2	4.4
개인	130.8	-40.5	90.3	0.0	-0.2	8.6	14.1	-1.8	0.0	-38.8
기관	-237.5	34.3	-203.2	3.2	-27.9	-187.2	-19.0	2.4	-1.6	33.3
금융투자	-132.0	55.3	-76.7	0.0	-2.9	21.2	-19.0	2.5	-2.1	40.6
투신	3.8	-1.9	1.9	0.0	-3.2	-196.0	0.0	0.0	-0.1	-9.0
은행+보험+기타금융	-15.5	-19.8	-35.3	0.0	-9.1	-10.3	0.0	0.0	0.6	1.5
연기금+국가지자체	-45.6	0.4	-45.2	3.3	-7.4	-2.1	0.0	0.0	0.0	0.2
기타법인	-12.4	-0.5	-12.8	0.0	-0.2	-15.5	1.2	-0.4	-0.6	1.0

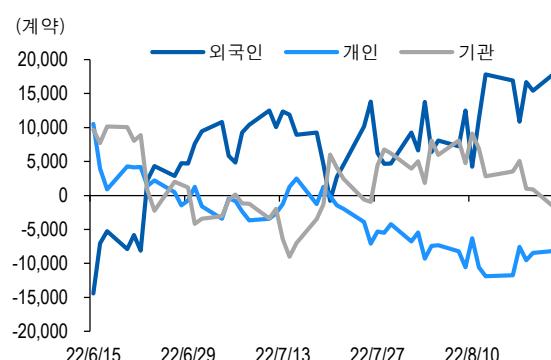
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	586,165	139.7	769,540	13.1%	지수옵션 전체	1,136,089	315.4	2,028,997
Put	549,924	175.7	1,259,457	17.3%	PCR(금액기준)	1.26	VKOSPI	16.76%(+1.03%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	335.0(K+3)	0.50	-0.81	95,416	21,163	4,250	13.1	330.0(K+1)
	332.5(K+2)	0.82	-1.18	82,092	17,662	5,288	13.0	327.5(K+0)
	330.0(K+1)	1.34	-1.57	71,294	20,906	4,142	13.2	325.0(K-1)
	327.5(K+0)	2.09	-2.03	41,312	8,055	3,563	13.4	322.5(K-2)
	325.0(K-1)	3.08	-2.43	22,105	10,968	2,983	13.6	320.0(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	330.0(K+1)	9.12	3.01	2,513	15,479	-293	17.4	
	327.5(K+0)	7.36	2.61	4,154	7,618	323	17.1	
	325.0(K-1)	5.80	2.13	8,849	14,403	629	16.9	
	322.5(K-2)	4.54	1.73	14,388	10,367	-621	17.1	
	320.0(K-3)	3.48	1.36	33,345	28,801	-1,391	17.3	

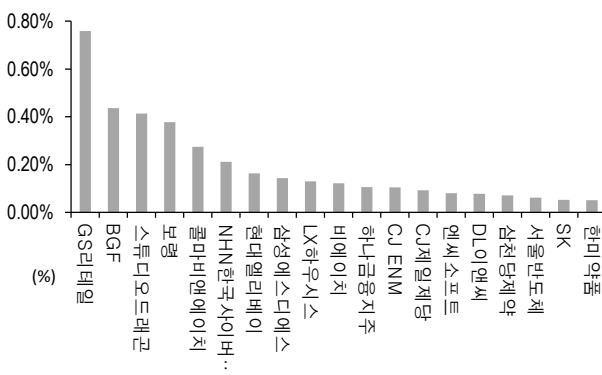
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,325,460	1,525.3	3,864,657	93,575	-360	-52,688	51,142	4.4	-38.8	33.3
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	6,510	-1.96	0.4	83.0	3,244	221	-0.08%	-102	303	-201
BGF	4,110	-3.52	0.4	75.5	3,216	1,737	0.44%	-1,420	384	1,136
현대차	188,500	-0.53	73.7	73.2	43,119	-1,214	-0.06%	-1,084	-989	2,073
LG화학	642,000	0.31	61.9	70.5	8,168	-57	-0.07%	-325	119	202
SK하이닉스	95,300	-0.94	152.9	70.5	174,879	4,932	-0.13%	-4,334	-9,294	13,466
삼성전자	60,100	-1.31	338.2	69.4	1,032,092	4,213	-0.03%	-4,697	-30,873	35,483
삼성전기	135,000	-1.46	23.3	69.3	30,095	811	-0.02%	1,106	673	-1,779
SK이노베이션	205,500	0.24	42.2	69.2	20,611	915	0.00%	-317	-67	384
LG전자	100,000	-0.50	43.7	66.2	27,169	1,329	-0.22%	572	-1,567	995
메리츠증권	4,850	-0.82	1.4	65.0	26,469	1,188	-0.35%	2,733	-6,103	3,370

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터