

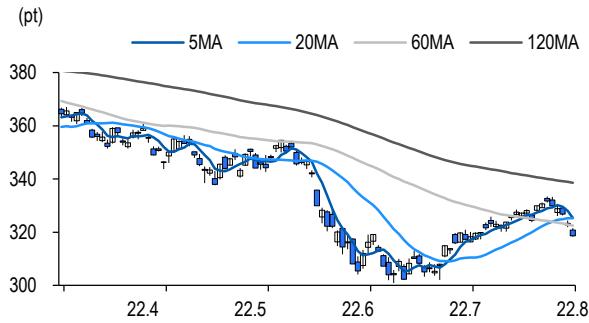


선물옵션시장 지표

2022.8.24

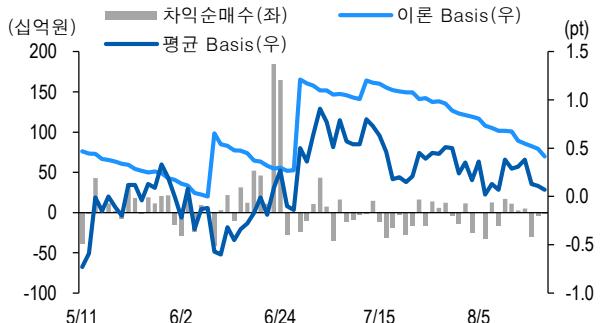
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	318.69	-1.26	-4.08	5,243.7	-
선물 9월물	318.15	-1.26	-4.05	19,003.5	305,470
선물 12월물	319.50	-1.22	-3.95	232.2	20,753
9월물(mini)	318.12	-1.27	-4.14	1,257.6	47,799
10월물(mini)	318.24	-1.33	-4.28	6.4	21,440



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.39	0.05	-0.54	-0.11%
베이시스(mini)	0.39	0.05	-0.57	-0.11%
제1스프레드(SP)	1.48	1.21	1.20	-0.09%
합성선물 베이시스(ATM)	0.39	-0.53	-0.53	-0.29%



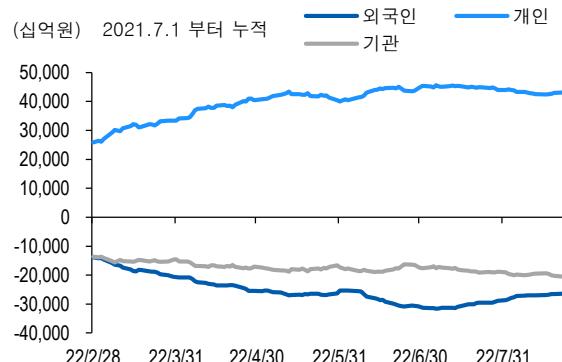
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	0.8	14.7	15.5	-8.8	65.9	-176.8	-16.6	-1.2	-0.8	5.4
개인	138.3	27.0	165.2	0.0	0.2	140.9	18.7	-1.8	2.7	3.3
기관	-131.0	-35.7	-166.7	-4.2	-33.2	45.9	-0.9	4.1	-2.6	-8.9
금융투자	-69.7	-39.2	-108.8	-1.5	0.0	412.3	0.5	4.1	-2.5	-3.3
투신	-19.3	-5.3	-24.5	0.0	-25.0	-332.0	-1.4	-0.2	-0.1	-5.2
은행+보험+기타금융	-10.7	-22.4	-33.0	0.0	-13.5	-31.6	0.0	0.2	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-20.5	27.9	7.4	-2.7	4.0	-2.7	0.0	0.0	0.0	-0.4
기타법인	-8.0	-6.0	-14.0	0.0	0.2	-10.0	-1.3	-1.1	0.6	0.2

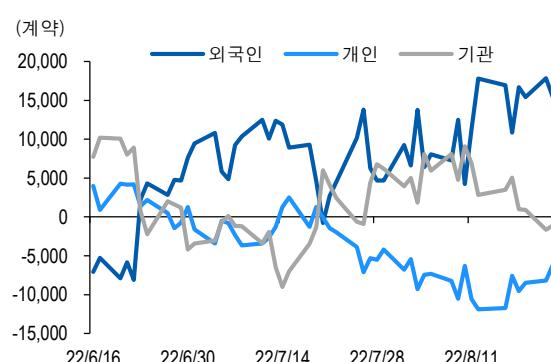
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	704,854	176.7	828,326	13.7%	지수옵션 전체	1,357,051	405.4	2,116,131
Put	652,197	228.7	1,287,805	18.5%	PCR(금액기준)	1.29	VKOSPI	17.72% (+0.96%p)
<hr/>								
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	330.0(K+3)	0.58	-0.76	113,206	27,845	6,939	13.5	325.0(K+1)
	327.5(K+2)	1.00	-1.09	106,587	15,846	7,791	13.7	322.5(K+0)
	325.0(K+1)	1.66	-1.42	63,638	15,866	4,898	14.2	320.0(K-1)
	322.5(K+0)	2.52	-1.78	23,901	5,939	2,419	14.5	317.5(K-2)
	320.0(K-1)	3.57	-2.16	14,553	9,509	1,578	14.6	315.0(K-3)
<hr/>								
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	325.0(K+1)	8.46	2.66	5,226	14,159	-244	17.9	
	322.5(K+0)	6.86	2.32	8,380	10,427	60	18.1	
	320.0(K-1)	5.40	1.92	21,096	28,859	58	18.0	
	317.5(K-2)	4.23	1.57	29,111	17,980	-1,040	18.2	
	315.0(K-3)	3.29	1.29	50,470	23,453	-293	18.6	

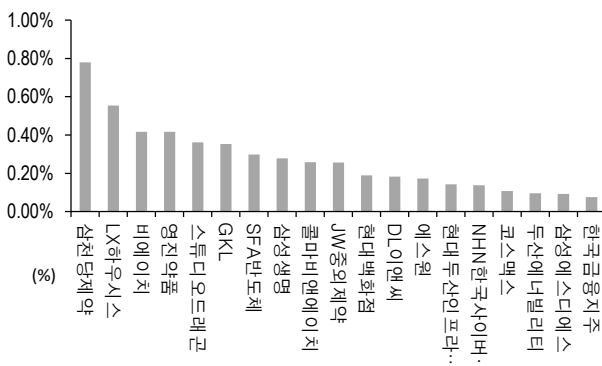
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,562,810	1,703.6	3,919,599	54,942	-16,646	27,637	-11,800	5.4	3.3	-8.9
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
BGF	4,070	-0.97	0.5	80.1	4,200	984	-0.12%	-183	274	-91
넥센타이어	6,500	-0.15	0.7	79.6	3,423	179	-0.27%	-843	-168	1,011
삼성전기	133,500	-1.11	29.5	77.3	29,960	-135	-0.10%	-530	635	-105
현대차	189,000	0.27	102.9	76.2	41,745	-1,374	-0.05%	-1,284	-113	1,407
삼성전자	59,300	-1.33	377.8	70.8	1,048,268	16,176	0.01%	1,217	20,549	-21,835
SK 하이닉스	94,000	-1.36	114.9	67.0	178,036	3,157	-0.15%	-4,794	-1,485	6,035
일진마티리얼즈	69,700	0.29	12.0	60.7	46,700	-2,053	-0.05%	1,703	-1,444	-259
SK 이노베이션	202,000	-1.70	29.0	59.6	18,804	-1,807	-0.03%	734	-1,916	1,107
엔씨소프트	364,500	-2.02	14.9	55.8	8,542	523	-0.02%	-462	517	-55
현대제철	32,150	-0.77	5.7	53.7	13,589	-994	-0.02%	1,989	830	-2,819

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터