

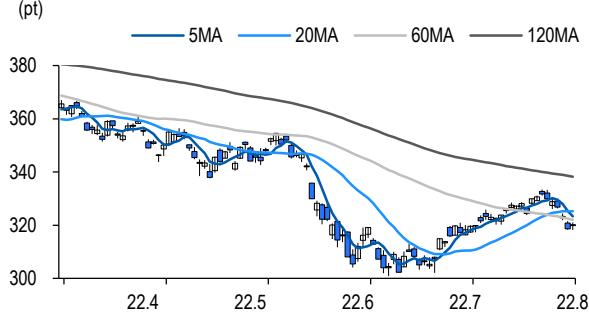


선물옵션시장 지표

2022.8.25

Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	319.86	0.37	1.17	6,231.4	-
선물 9월물	319.60	0.46	1.45	16,545.7	301,797
선물 12월물	320.85	0.42	1.35	155.9	20,861
9월물(mini)	319.68	0.48	1.56	1,210.1	50,798
10월물(mini)	319.72	0.47	1.48	6.0	21,941



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.36	-0.01	-0.26	-0.12%
베이시스(mini)	0.36	0.00	-0.18	-0.11%
제1스프레드(SP)	1.49	1.15	1.15	-0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	0.36	-0.28	-0.28	-0.20%



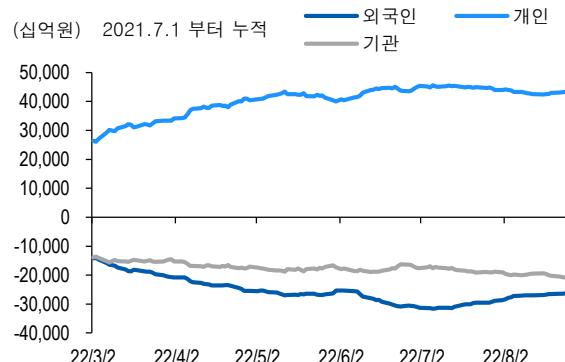
투자주체별 매매 동향

(십억원)

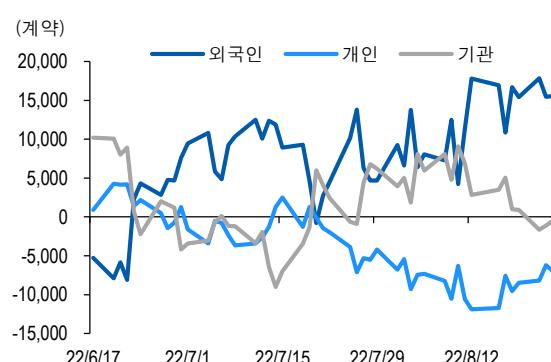
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	150.7	-36.9	113.8	-2.1	95.4	-4.3	11.9	1.4	-1.3	8.4
개인	-4.6	43.2	38.5	0.0	0.3	-43.4	-17.3	-1.5	1.3	30.3
기관	-141.1	-8.4	-149.4	-5.0	-18.8	42.3	5.4	0.4	-0.3	-38.4
금융투자	-154.8	-4.7	-159.5	-2.0	-5.5	-221.9	10.1	0.7	-0.2	-26.5
투신	37.3	-23.4	13.9	0.0	-7.2	267.1	-4.8	-0.3	-0.1	-7.6
은행+보험+기타금융	7.0	9.2	16.3	0.0	8.8	-8.3	0.1	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-7.0	8.6	1.6	-1.6	0.3	5.4	0.0	0.0	0.0	-4.3
기타법인	-5.0	2.1	-2.9	0.0	-2.2	5.4	0.0	-0.3	0.3	-0.3

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	582,019	159.0	850,654	14.2%	지수옵션 전체	1,141,457	326.0	2,189,691						
Put	559,438	167.0	1,339,037	18.5%	PCR(금액기준)	1.05	VKOSPI	17.48%(-0.24%p)						
(계약, 십억원)														
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
	325.0(K+3)	1.91	0.25	80,284	17,814	1,948	14.2	Put						
	322.5(K+2)	2.89	0.37	35,052	7,669	1,730	14.6	320.0(K+1)	4.47	-0.93	14,979	29,294	435	17.2
	320.0(K+1)	4.08	0.51	18,769	11,953	2,444	14.8	317.5(K+0)	3.46	-0.77	18,925	17,737	-243	17.7
	317.5(K+0)	5.54	0.65	4,743	2,184	873	15.1	315.0(K-1)	2.60	-0.69	39,759	25,118	1,665	18.0
	315.0(K-1)	7.20	0.78	2,750	1,815	141	15.3	312.5(K-2)	1.96	-0.57	45,995	22,047	983	18.5
	310.0(K-3)							310.0(K-3)	1.46	-0.43	66,090	26,061	2,537	19.0

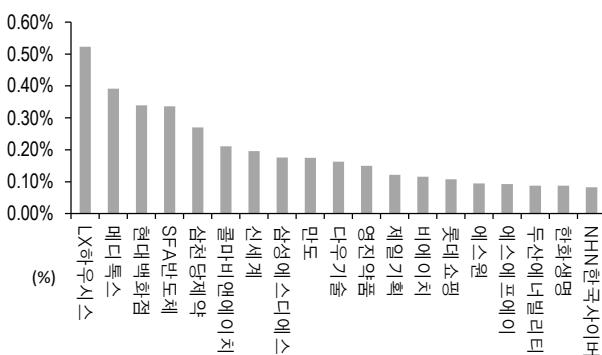
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,564,398	1,671.5	4,025,865	106,266	11,652	52,328	-63,926	8.4	30.3	-38.4
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	187,500	-0.79	132.1	100.8	41,698	-47	-0.10%	278	-880	602
넥센타이어	6,560	0.92	0.6	70.9	3,494	71	-0.12%	773	138	-911
BGF	4,120	1.23	0.7	65.2	4,293	93	-0.93%	728	3	-731
메리츠증권	4,720	-0.42	2.3	64.5	34,865	3,139	-0.40%	113	-137	-263
SK 하이닉스	93,300	-0.74	86.6	64.3	179,872	1,836	-0.13%	1,826	3,659	-5,436
SK 이노베이션	205,500	1.73	52.1	60.2	19,731	927	0.01%	-703	-329	1,213
엔씨소프트	361,000	-0.96	11.7	52.6	8,470	-72	0.04%	-18	-101	119
현대위아	68,500	0.74	4.8	52.1	4,226	1,049	-0.20%	406	-30	-376
LG 화학	615,000	-0.97	67.0	51.7	8,199	93	-0.05%	977	-336	-601
일진머티리얼즈	70,800	1.58	11.5	51.5	45,919	-781	-0.14%	467	-1,028	561

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터