

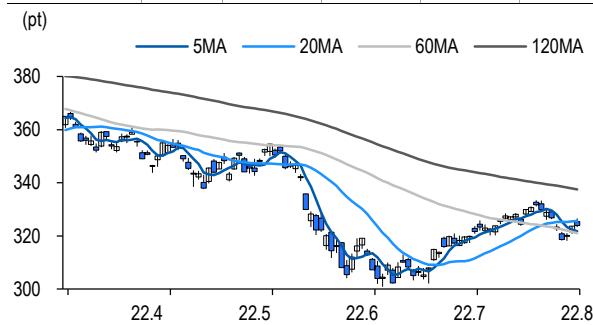


선물옵션시장 지표

2022.8.29

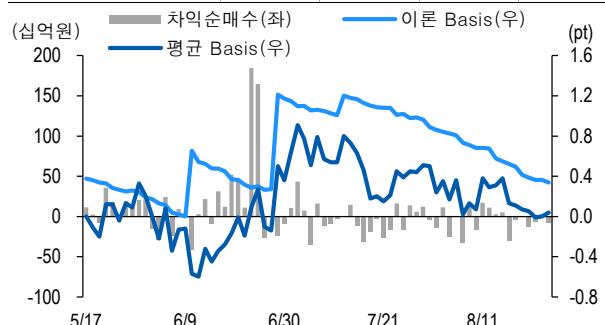
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	323.91	0.09	0.28	5,592.0	-
선물 9월물	324.50	0.20	0.65	16,580.3	302,255
선물 12월물	325.40	0.11	0.35	109.0	21,771
9월물(mini)	324.50	0.20	0.60	1,176.3	52,720
10월물(mini)	324.24	0.11	0.36	3.7	22,604



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.34	0.04	0.59	-0.09%
베이시스(mini)	0.34	0.03	0.59	-0.09%
제1스프레드(SP)	1.65	1.19	1.15	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.34	0.59	0.59	0.08%



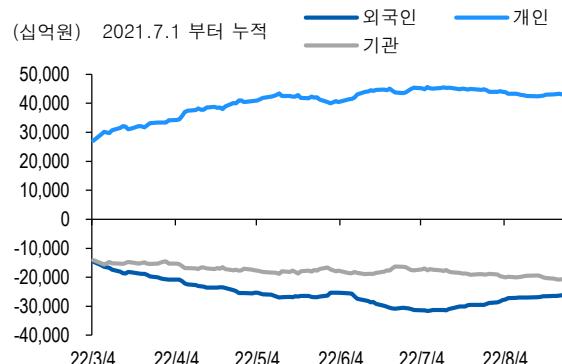
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	134.2	-3.5	130.6	-3.6	7.3	-97.0	-7.4	0.9	0.0	-15.5
개인	-254.3	-16.8	-271.0	0.0	1.1	59.1	5.6	0.7	-1.0	-23.8
기관	100.6	19.6	120.2	-4.4	-24.9	28.1	0.8	-2.3	1.7	39.6
금융투자	49.8	33.5	83.2	-7.7	-1.6	139.3	2.4	-1.0	-0.5	32.3
투신	14.0	1.0	15.0	0.0	0.1	-153.8	-1.6	0.0	0.0	3.4
은행+보험+기타금융	6.5	-15.7	-9.2	0.0	-2.1	43.3	0.0	-1.3	2.1	-0.6
연기금+국가지자체	-1.0	-0.2	-1.2	3.3	-19.4	-0.7	0.0	0.0	0.0	4.5
기타법인	19.6	0.7	20.2	0.0	0.0	9.7	1.0	0.6	-0.6	-0.3

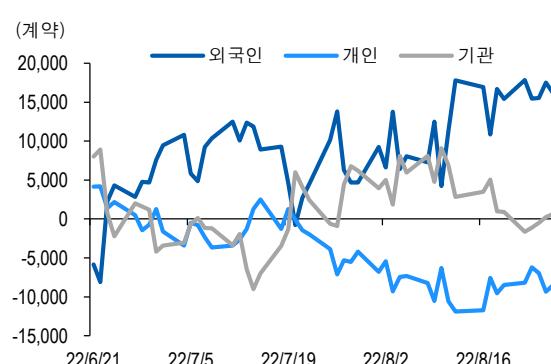
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)															
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	656,169	181.3	880,497	13.6%	지수옵션 전체	1,383,883	339.1	2,318,301							
Put	727,714	157.9	1,437,804	15.7%	PCR(금액기준)	0.87	VKOSPI	16.19%(0.00%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	330.0(K+3)	1.33	0.06	100,254	31,685	-486	13.6	Put	325.0(K+1)	3.89	-0.42	21,026	16,932	2,025	13.9
	327.5(K+2)	2.15	0.05	71,087	16,397	-316	13.9		322.5(K+0)	2.85	-0.34	42,909	11,638	1,222	14.5
	325.0(K+1)	3.36	0.16	33,044	18,197	-104	14.7		320.0(K-1)	2.07	-0.25	53,065	32,129	1,428	15.2
	322.5(K+0)	4.85	0.28	7,519	7,961	-700	15.5		317.5(K-2)	1.46	-0.22	75,089	22,627	4,383	15.8
	320.0(K-1)	6.50	0.29	3,925	12,920	-372	15.9		315.0(K-3)	1.02	-0.17	76,371	29,064	3,800	16.4

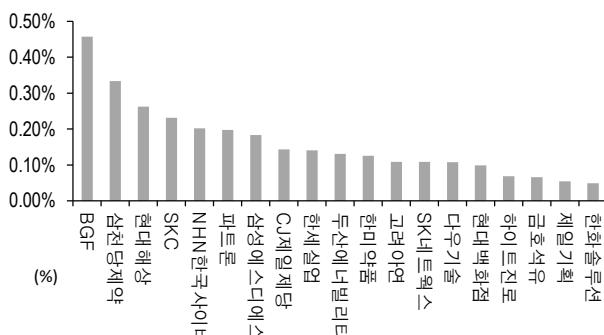
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)
주식선물 전체	3,351,453	1,797.1	4,216,625	108,580	-24,959	26,896	-1,493	-15.5	-23.8	39.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	60,000	0.50	471.8	82.7	1,023,264	-8,788	-0.03%	3,101	-3,904	429
SK 하이닉스	95,200	1.06	170.1	77.6	178,199	-3,321	-0.02%	1,759	-3,788	2,012
SK	234,000	0.00	11.9	61.7	7,782	-52	-0.09%	-283	-48	324
고려아연	586,000	0.00	12.3	61.3	3,735	189	0.11%	24	-214	192
현대차	193,500	0.78	55.8	61.1	41,518	-1,480	-0.14%	637	-1,569	942
LG 이노텍	343,500	0.73	57.4	53.7	7,394	616	-0.03%	538	738	-1,276
일진미터리얼즈	73,400	-0.14	9.3	53.7	48,759	-389	-0.02%	-1,501	764	749
포스코케미칼	163,000	-2.40	42.8	49.8	19,207	-2,699	-0.30%	1,370	-9,066	7,729
현대위아	71,700	0.28	3.6	49.0	5,260	-13	-0.06%	-397	221	176
삼성전기	138,500	1.09	30.3	47.9	30,131	2,174	-0.19%	847	-284	-563

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터