

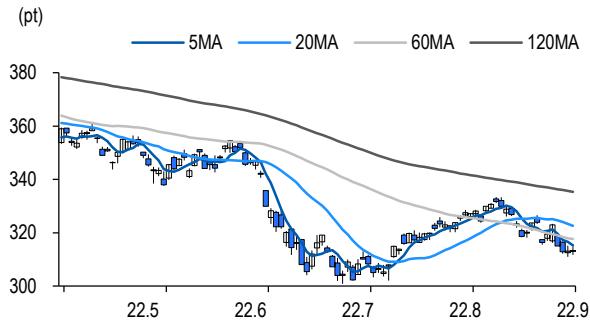


선물옵션시장 지표

2022.9.7

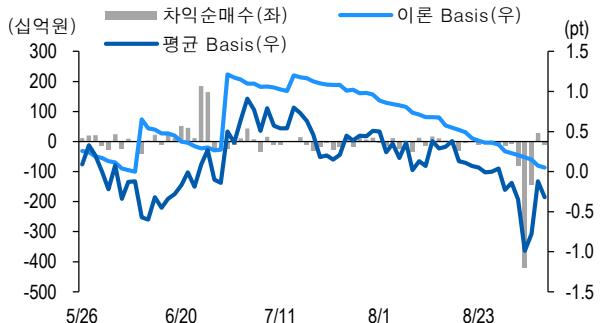
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	313.01	0.17	0.54	3,784.7	-
선물 9월물	312.90	0.26	0.80	19,386.2	222,645
선물 12월물	313.50	0.24	0.75	3,115.9	172,932
9월물(mini)	313.00	0.29	0.92	1,350.5	61,629
10월물(mini)	312.80	0.10	0.32	53.4	41,345



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.05	-0.32	-0.11	-0.12%
베이시스(mini)	0.05	-0.32	-0.01	-0.12%
제1스프레드(SP)	1.57	0.82	0.75	-0.24%
합성선물 베이시스(ATM)	0.05	0.05	0.05	0.00%



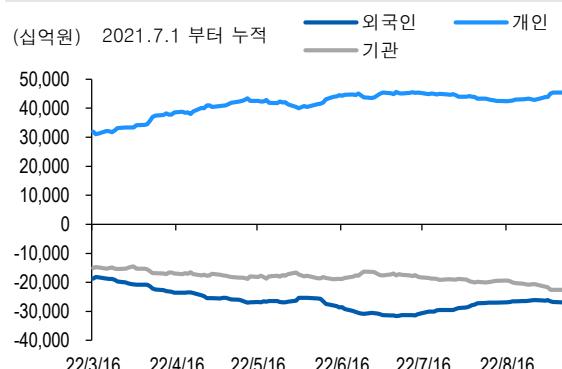
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-79.4	33.6	-45.8	0.7	-54.8	-236.4	25.2	2.6	3.6	1.8
개인	85.4	-6.5	78.9	0.0	-0.2	113.0	-17.6	-2.3	-1.6	44.2
기관	-13.2	-25.5	-38.8	-10.3	-9.1	129.5	-7.4	1.0	-1.5	-47.6
금융투자	-27.9	-11.4	-39.3	-2.5	-1.2	304.3	-9.4	1.6	0.1	-77.2
투신	23.5	-16.7	6.7	0.0	-0.4	-150.7	1.3	-0.2	0.0	19.7
은행+보험+기타금융	5.0	1.9	6.8	0.0	8.3	-32.9	0.6	-0.4	-1.6	-0.1
연기금+국가지자체	-11.0	-1.0	-11.9	-7.8	-14.3	8.8	0.0	0.0	0.0	10.0
기타법인	7.3	-1.6	5.7	0.0	-0.4	-6.1	-0.2	-1.4	-0.5	1.6

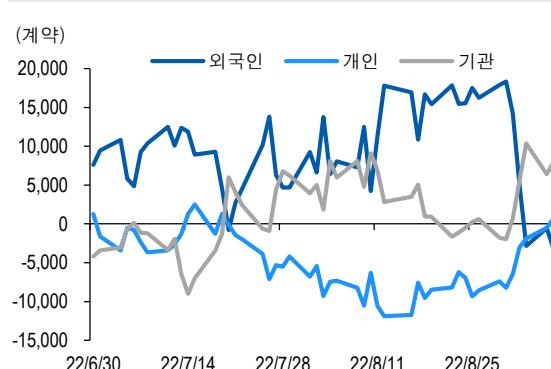
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,707,980	307.4	1,353,671	15.4%	지수옵션 전체	3,485,095	634.3	3,213,921
Put	1,777,115	326.9	1,860,250	17.9%	PCR(금액기준)	1.06	VKOSPI	18.49%(-0.38%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	320.0(K+3)	0.10	-0.03	268,812	58,666	-1,410	15.0	315.0(K+1)
	317.5(K+2)	0.33	-0.07	462,279	49,497	8,160	14.9	312.5(K+0)
	315.0(K+1)	0.96	-0.08	400,339	27,779	3,593	15.4	310.0(K-1)
	312.5(K+0)	2.18	0.08	192,192	14,435	3,352	16.6	307.5(K-2)
	310.0(K-1)	3.79	0.18	36,505	11,274	2,198	16.5	305.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	315.0(K+1)	2.89	-0.96	66,544	29,132	-24	15.6	312.5(K+0)
	312.5(K+0)	1.62	-0.78	187,358	27,052	-38	16.8	310.0(K-1)
	310.0(K-1)	0.80	-0.64	339,132	42,775	4,457	17.5	307.5(K-2)
	307.5(K-2)	0.34	-0.46	336,860	46,616	5,136	17.9	305.0(K-3)
	305.0(K-3)	0.13	-0.31	325,441	52,506	5,835	18.4	

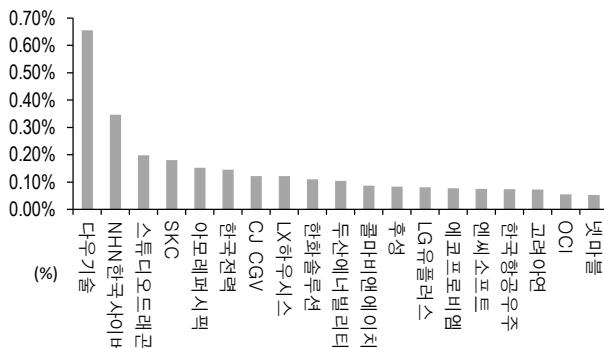
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,862,789	1,926.1	5,178,697	152,661	-27,872	63,223	-37,566	1.8	44.2	-47.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK 하이닉스	91,800	0.55	150.8	118.8	176,565	-18,086	0.01%	1,042	10,960	-11,984
삼성전자	57,000	-0.18	333.9	78.2	782,897	-192,251	-0.02%	-1,632	25,349	-23,747
현대차	201,000	0.25	89.4	76.0	42,583	-4,924	-0.06%	990	-258	-971
LG 화학	621,000	0.81	41.9	75.9	8,043	-339	-0.15%	56	-186	51
KB 금융	47,950	-0.42	17.2	71.8	48,056	-4,198	-0.07%	-529	976	-447
엔씨소프트	374,500	-0.66	10.9	70.7	9,048	-125	0.08%	6	189	-195
하나금융지주	37,900	-0.13	14.9	62.5	69,946	-19,715	0.00%	-833	14	750
삼성전기	139,000	2.21	27.5	62.4	23,198	-4,695	-0.02%	436	-706	198
한국조선해양	92,200	0.44	6.1	58.2	8,760	-49	-0.08%	-445	177	268
POSCO 퀄딩스	252,000	-0.40	30.2	57.9	8,979	-1,404	-0.05%	83	780	-931

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터