

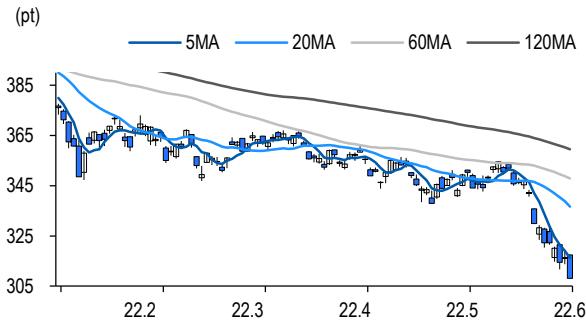


선물옵션시장 지표

2022.6.23

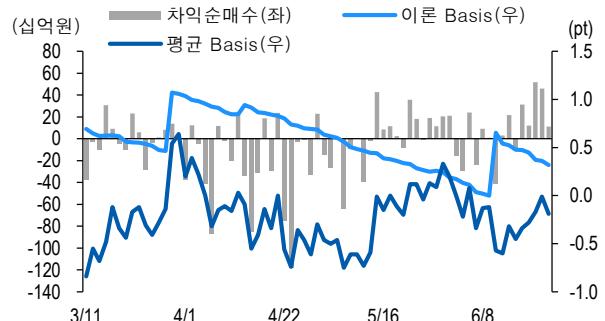
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	308.08	-2.62	-8.30	6,474.2	-
선물 9월물	308.30	-2.65	-8.40	28,756.3	318,411
선물 12월물	309.10	-2.65	-8.40	69.4	17,457
7월물(mini)	307.64	-2.76	-8.74	2,432.8	93,656
8월물(mini)	307.82	-2.69	-8.52	7.6	4,353



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.32	-0.19	0.22	-0.16%
베이시스(mini)	-0.61	-0.59	-0.44	0.01%
제1스프레드(SP)	0.81	0.72	0.65	-0.03%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.61	-0.31	-0.31	0.10%



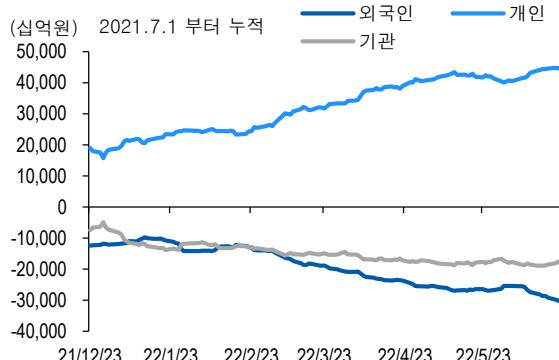
투자주체별 매매 동향

(십억원)

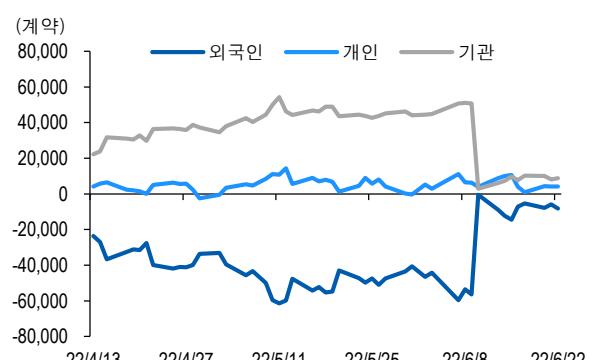
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-321.0	-28.9	-349.9	-2.9	-174.3	-71.3	-116.7	7.1	-8.0	-9.4
개인	375.1	101.1	476.3	0.0	0.9	-37.3	42.4	-5.8	7.9	-36.5
기관	-83.5	-92.6	-176.1	14.1	-4.8	7.8	69.4	-1.1	-0.1	46.7
금융투자	31.7	-106.7	-75.0	13.1	-2.7	723.4	69.7	0.9	-1.3	42.4
투신	-42.9	-5.4	-48.3	0.0	-0.3	-694.8	-0.3	-0.1	-0.1	-2.3
은행+보험+기타금융	-16.3	16.0	-0.4	0.0	-0.2	-22.2	0.0	-1.9	1.3	0.0
연기금+국가지자체	-33.1	2.9	-30.2	-0.5	0.7	1.4	0.0	0.0	0.0	6.6
기타법인	29.3	20.3	49.7	0.0	0.1	100.9	4.9	-0.3	0.2	-0.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

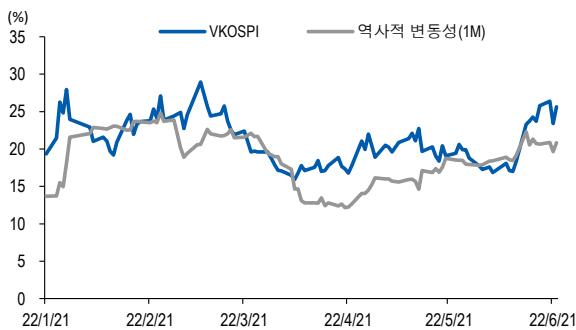
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	958,723	227.2	969,955	21.0%	지수옵션 전체	2,092,515	682.8	2,148,836
Put	1,133,792	455.6	1,178,881	22.4%	PCR(금액기준)	2.01	VKOSPI	25.64% (+2.24%p)
<hr/>								
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	325.0(K+3)	1.24	-1.91	67,602	14,403	5,194	20.9	320.0(K+1)
	322.5(K+2)	1.73	-2.34	40,495	8,020	2,185	21.4	317.5(K+0)
	320.0(K+1)	2.30	-2.85	34,320	10,465	4,599	21.6	315.0(K-1)
	317.5(K+0)	3.07	-3.28	16,476	4,673	2,268	22.2	312.5(K-2)
	315.0(K-1)	3.89	-3.83	8,804	3,931	794	22.5	310.0(K-3)
<hr/>								
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	320.0(K+1)	14.70	5.88	3,266	16,859	164	21.3	320.0(K+1)
	317.5(K+0)	12.80	5.30	3,476	9,466	-154	21.3	317.5(K+0)
	315.0(K-1)	11.10	4.71	10,588	16,804	368	21.5	315.0(K-1)
	312.5(K-2)	9.78	4.34	7,178	7,090	8	22.6	312.5(K-2)
	310.0(K-3)	8.46	3.87	12,769	17,455	32	23.1	310.0(K-3)

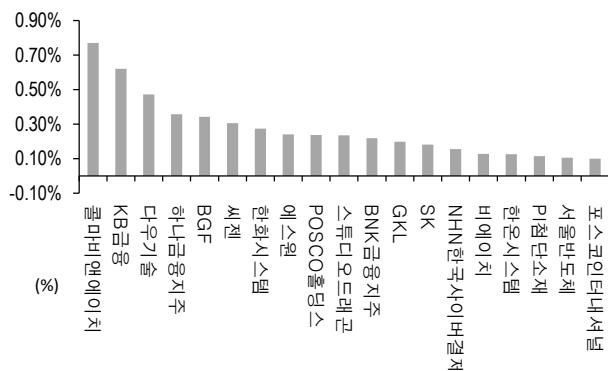
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,428,926	2,713.1	4,258,604	143,071	-43,622	-53,811	99,496	-9.4	-36.5	46.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	170,500	-0.87	93.6	86.0	43,261	59	0.01%	-1,109	-1,294	2,405
삼성전자	57,400	-1.54	1,111.8	82.8	1,245,299	-594	0.01%	-6,623	-60,425	67,646
삼성전기	132,000	-4.69	102.1	77.2	35,732	2,949	-0.10%	-800	3,910	-3,226
현대위아	52,100	-2.98	5.4	63.2	4,679	-94	-0.09%	-412	142	270
넥센타이어	5,500	-2.48	0.6	58.3	3,888	-1,115	-0.09%	-1,144	355	789
일진마티리얼즈	73,800	-4.16	18.7	57.1	66,301	-1,404	-0.12%	-75	-2,365	2,440
SK 하이닉스	92,100	-3.05	183.7	56.9	206,273	22,657	-0.28%	-1,946	12,941	-10,947
LG 화학	556,000	-1.94	65.6	56.2	8,875	190	0.01%	593	-496	-97
현대건설	37,650	-4.32	10.1	56.1	17,556	550	-0.10%	-1,641	586	939
현대미포조선	86,000	-1.26	14.9	54.0	11,426	1,342	-0.15%	-55	-2,584	2,597

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터