

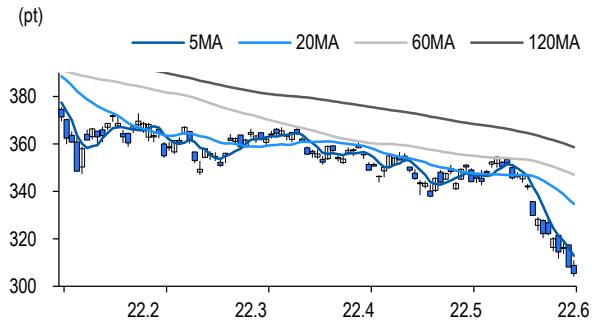


## 선물옵션시장 지표

2022.6.24

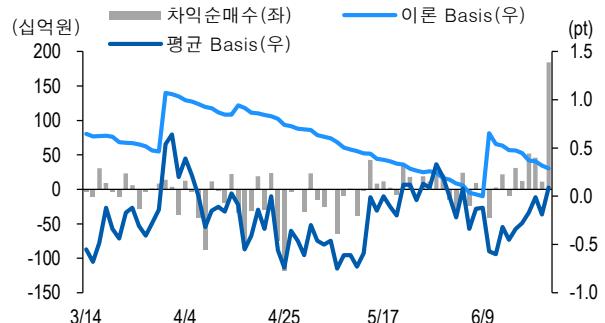
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	305.45	-0.85	-2.63	7,731.1	-
선물 9월물	306.10	-0.71	-2.20	39,520.8	319,074
선물 12월물	306.85	-0.73	-2.25	65.1	17,569
7월물(mini)	305.50	-0.70	-2.14	3,586.9	101,652
8월물(mini)	305.78	-0.66	-2.04	14.8	4,508



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.29	0.09	0.65	-0.07%
베이시스(mini)	-0.63	-0.45	0.05	0.06%
제1스프레드(SP)	0.80	0.72	0.75	-0.03%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.63	-0.02	-0.02	0.20%



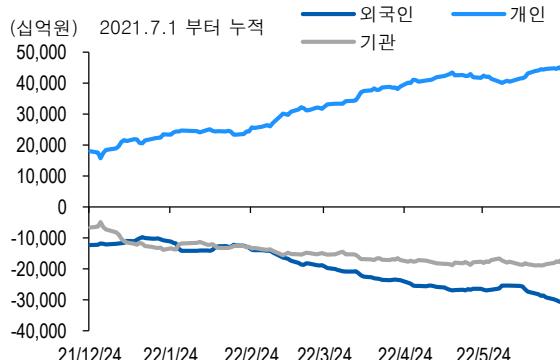
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

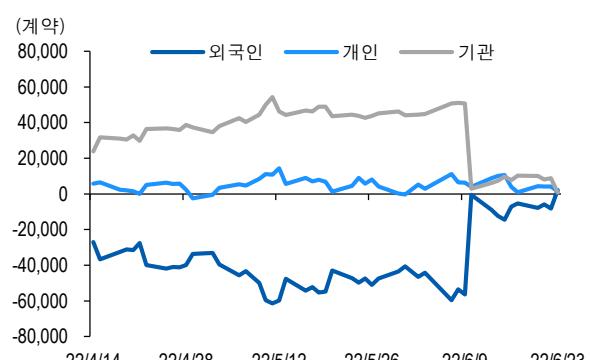
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-296.3	29.7	-266.5	19.6	-185.3	749.2	49.9	0.7	-4.2	-2.6
개인	-672.2	10.0	-662.2	0.0	0.0	-242.5	29.8	-2.2	8.3	-5.9
기관	926.4	-68.3	858.1	165.0	121.1	-545.9	-84.1	2.1	-4.2	8.4
금융투자	974.4	-52.5	921.9	132.5	78.8	-560.7	-85.0	3.1	-4.6	-22.9
투신	19.6	-17.4	2.2	0.0	32.3	91.9	0.7	0.0	0.4	12.2
은행+보험+기타금융	-44.6	5.6	-39.0	0.0	-0.3	-43.1	0.2	-1.1	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-25.0	18.0	-7.0	10.9	-18.0	-34.1	0.0	0.0	0.0	19.1
기타법인	42.1	28.5	70.7	0.0	0.3	39.3	4.4	-0.5	0.1	0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

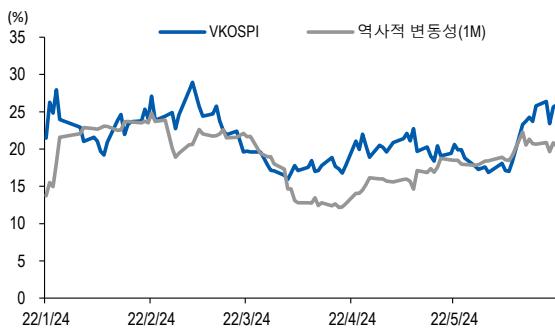
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,122,929	354.7	1,008,444	23.0%	지수옵션 전체	2,384,200	886.6	2,227,532
Put	1,261,271	531.9	1,219,088	23.5%	PCR(금액기준)	1.50	VKOSPI	25.92% (+0.28%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	315.0(K+3)	2.96	-0.93	35,937	6,199	2,268	22.7	310.0(K+1)
	312.5(K+2)	3.89	-1.08	18,938	3,313	1,883	23.4	307.5(K+0)
	310.0(K+1)	4.92	-1.19	15,991	4,310	2,560	23.9	305.0(K-1)
	307.5(K+0)	6.07	-1.39	11,069	1,702	1,107	24.4	302.5(K-2)
	305.0(K-1)	7.41	-1.47	6,946	1,532	753	25.1	300.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	310.0(K+1)	9.50	1.04	9,816	17,483	28	22.0	310.0(K+1)
	307.5(K+0)	8.14	0.89	15,150	8,307	107	22.5	307.5(K+0)
	305.0(K-1)	6.95	0.76	21,845	12,644	674	23.1	305.0(K-1)
	302.5(K-2)	5.95	0.73	15,741	9,947	781	23.8	302.5(K-2)
	300.0(K-3)	5.03	0.55	33,826	23,666	-100	24.3	300.0(K-3)

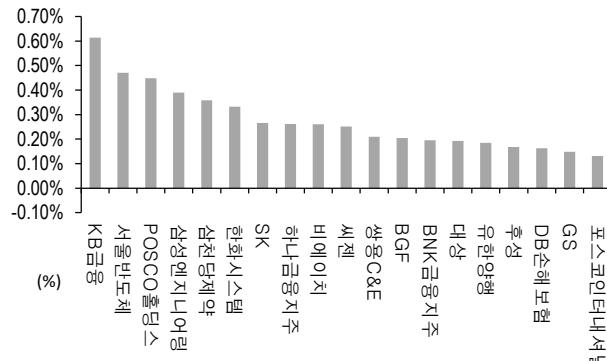
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	6,151,350	3,562.1	4,514,563	255,959	38,265	10,844	-49,448	-2.6	-5.9	8.4
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	57,200	-0.35	1,367.3	84.8	1,329,327	84,028	0.13%	10,985	5,542	-16,221
넥센타이어	5,200	-5.45	1.1	84.4	6,910	3,022	-0.06%	3,492	1,028	-4,520
삼성전기	128,000	-3.03	137.4	83.1	35,380	-352	-0.04%	4,638	-3,786	-868
현대차	170,500	0.00	112.1	80.9	42,497	-764	0.01%	-3,724	-788	4,542
호텔신라	67,600	-1.74	16.4	79.0	12,772	-1,814	0.00%	41	13	-104
카카오	67,100	-2.19	90.6	67.0	59,648	2,693	-0.08%	3,482	-4,150	644
SK 하이닉스	90,200	-2.06	240.9	66.7	219,169	12,896	-0.24%	-2,719	11,385	-8,606
일진마티리얼즈	69,600	-5.69	28.5	65.6	65,418	-883	-0.16%	1,739	-4,183	2,450
넷마블	69,500	1.02	10.2	63.2	8,260	-1,270	0.10%	-631	234	448
현대위아	50,700	-2.69	7.1	62.7	4,911	232	-0.07%	-795	227	568

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터