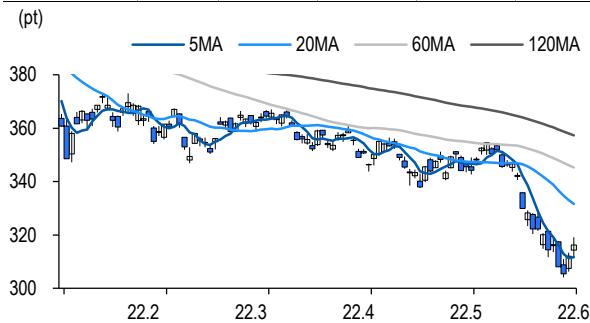


선물옵션시장 지표

2022.6.28

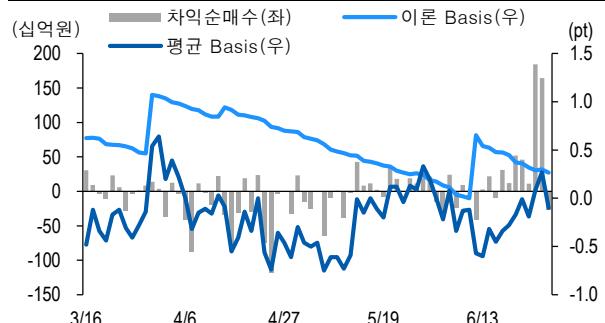
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.20	1.32	4.13	5,828.1	-
선물 9월물	316.60	1.25	3.90	28,886.6	310,000
선물 12월물	317.25	1.28	4.00	30.8	17,648
7월물(mini)	316.02	1.33	4.16	1,999.0	99,540
8월물(mini)	316.10	1.22	3.80	7.7	8,775



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.26	-0.10	0.40	-0.12%
베이시스(mini)	-0.68	-0.69	-0.18	0.00%
제1스프레드(SP)	0.87	0.77	0.75	-0.03%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.68	-0.49	-0.49	0.06%



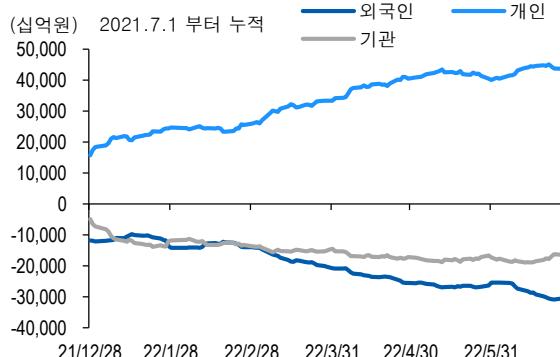
투자주체별 매매 동향

(십억원)

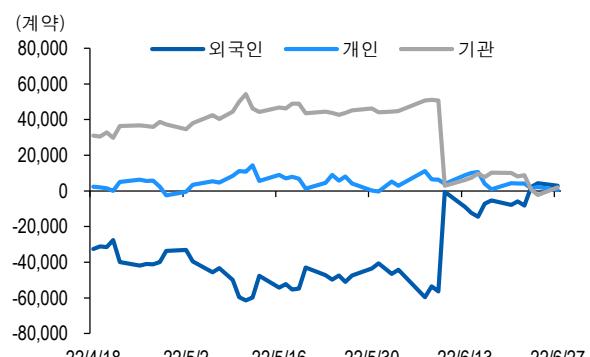
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	265.9	-4.8	261.0	-8.1	46.0	-181.8	63.3	-0.5	9.4	0.4
개인	-93.5	-59.8	-153.3	0.0	-0.9	-92.4	-39.8	2.5	-5.2	-4.0
기관	-205.5	63.6	-141.9	-19.1	17.9	350.9	-16.5	-2.0	-2.7	2.8
금융투자	-286.6	51.4	-235.2	-0.3	1.4	239.8	-15.3	-1.6	-0.8	-24.2
투신	47.5	29.6	77.1	0.0	9.8	92.6	-1.1	-0.1	-0.1	16.3
은행+보험+기타금융	6.7	-14.4	-7.7	0.0	4.4	2.1	-0.1	-0.3	-1.8	1.9
연기금+국가지자체	-34.1	0.9	-33.2	-18.8	-3.8	16.4	0.0	0.0	0.0	8.7
기타법인	33.1	1.1	34.1	0.0	1.4	-76.8	-7.0	0.0	-1.5	0.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

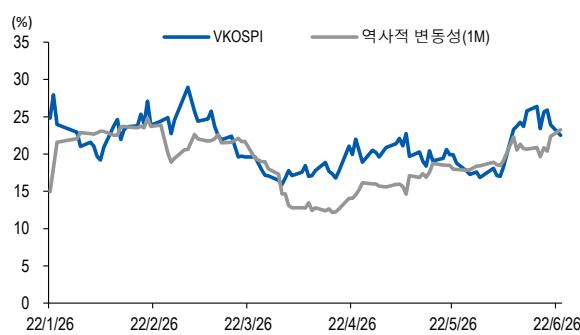


선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정						
Call	1,242,312	364.7	1,066,419	20.1%	지수옵션 전체		2,500,895	644.5	2,399,594						
Put	1,258,583	279.7	1,333,175	21.9%	PCR(금액기준)		0.77	VKOSPI	22.50%(-1.44%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내체변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량			
Call	320.0(K+3)	3.80	0.93	32,931	14,422	-464	20.4	Put	315.0(K+1)	5.40	-2.85	15,117	18,238	979	20.3
	317.5(K+2)	4.81	0.98	15,062	6,156	-119	20.5		312.5(K+0)	4.40	-2.45	9,779	7,045	-40	20.9
	315.0(K+1)	6.27	1.36	10,463	5,973	-462	21.5		310.0(K-1)	3.57	-2.18	19,602	19,058	730	21.4
	312.5(K+0)	7.61	1.41	4,792	3,224	-279	21.4		307.5(K-2)	2.86	-1.96	26,824	9,700	1,350	22.0
	310.0(K-1)	9.27	1.64	3,596	4,425	-103	22.0		305.0(K-3)	2.23	-1.79	44,753	14,556	1,513	22.2

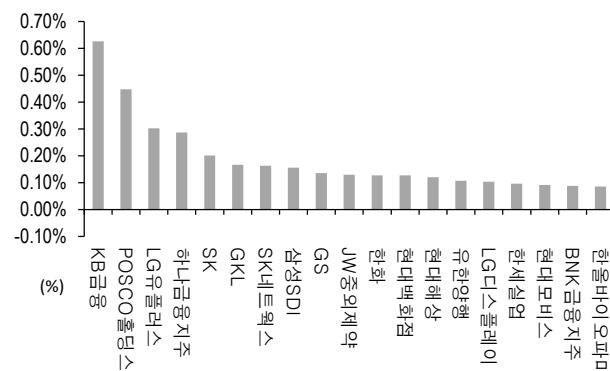
자료: KRX, 유안티증권 리서치센-

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KBX 유아티즈권 리서치센트

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KBX 유파티^{증권} 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	3,784,215	2,530.4	4,576,145	-11,577	18,189	-14,628	-6,440	0.4	-4.0	2.8		
<hr/>												
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균파리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전기	135,500	3.44	80.4	111.1	33,219	-1,577	-0.10%	1,844	-695	-1,023	-890	-1,658
넥센타이어	5,500	1.66	0.7	90.1	8,597	582	-0.04%	466	34	-500	-500	0
일진마티리얼즈	78,200	-0.38	46.6	89.9	74,064	6,136	0.03%	-4,144	8,396	-4,254	-2,927	-1,323
삼성전자	58,800	0.86	946.6	89.1	1,345,196	-28,477	0.08%	-9,259	-34,691	43,078	-2,501	36,749
호텔신라	70,400	2.03	9.3	72.7	12,044	-783	0.01%	1	-377	376	113	263
현대차	182,500	5.49	161.1	65.9	53,955	11,397	0.01%	-3,476	11,644	-7,996	-7,076	-1,010
삼성 SDI	572,000	3.44	90.8	62.2	20,453	2,102	0.16%	-108	2,145	-2,031	-2,510	-749
현대건설	38,250	2.55	9.1	61.4	15,246	-1,742	-0.02%	-1,336	-118	1,454	1,099	355
한국금융지주	62,700	1.95	5.4	58.8	29,439	-94	0.05%	1,039	-915	-124	-62	-59
카카오	71,700	0.28	62.0	58.7	61,095	-1,610	-0.05%	-3,456	996	2,460	7,151	-4,686

자료: KBX 유아티즈권 리서치센터