

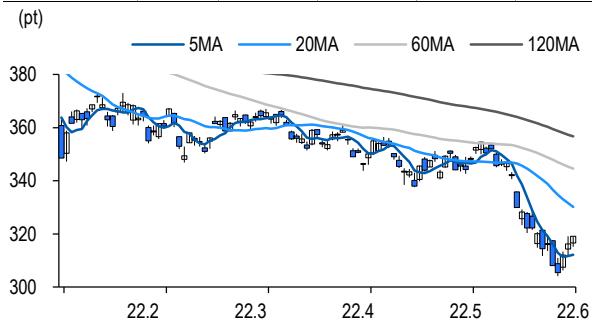


선물옵션시장 지표

2022.6.29

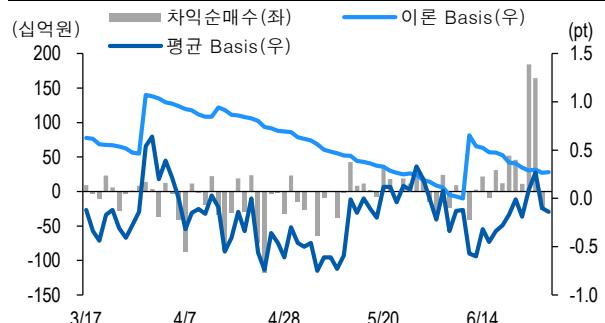
Market Data (십억원, 계약)

| | 종가(pt) | 등락률(%) | 등락폭(pt) | 거래대금 | 미결제 |
|-----------|--------|--------|---------|----------|---------|
| KOSPI200 | 319.11 | 0.92 | 2.91 | 5,056.1 | - |
| 선물 9월물 | 318.95 | 0.74 | 2.35 | 25,438.6 | 305,042 |
| 선물 12월물 | 319.70 | 0.77 | 2.45 | 28.4 | 18,186 |
| 7월물(mini) | 318.42 | 0.76 | 2.40 | 1,925.5 | 98,466 |
| 8월물(mini) | 318.88 | 0.88 | 2.78 | 5.5 | 10,393 |



차익거래 관련 Market data (pt)

| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) |
|----------------|-------|-------|-------|--------|
| K200 베이시스 | 0.27 | -0.14 | -0.16 | -0.13% |
| 베이시스(mini) | -0.69 | -0.69 | -0.69 | 0.00% |
| 제1스프레드(SP) | 0.88 | 0.77 | 0.75 | -0.03% |
| 합성선물 베이시스(ATM) | -0.69 | -0.70 | -0.70 | 0.00% |



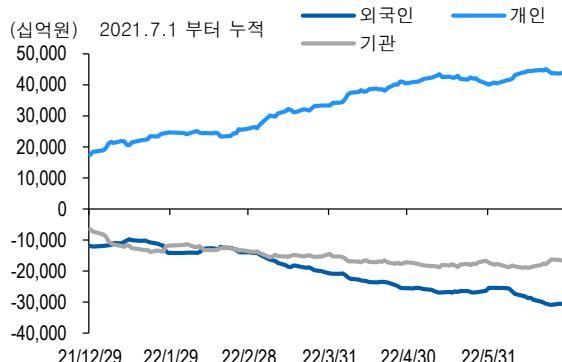
투자주체별 매매 동향

(십억원)

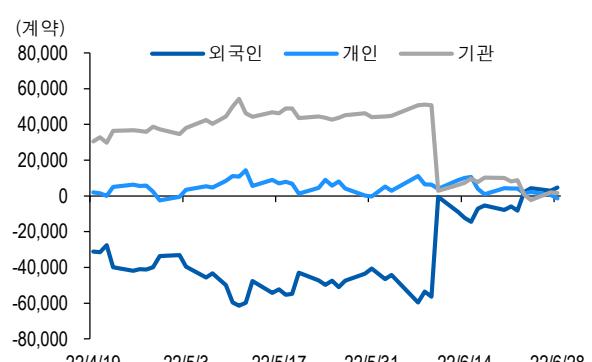
| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 |
|------------|-------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|
| 외국인 | -37.6 | 12.0 | -25.6 | -6.9 | -77.5 | 153.5 | -2.5 | -2.8 | 9.6 | -16.0 |
| 개인 | 106.1 | 22.3 | 128.3 | 0.0 | -0.1 | -172.3 | 18.9 | 3.9 | -0.3 | -29.6 |
| 기관 | -88.6 | -33.4 | -122.1 | 6.4 | -35.5 | -16.8 | -14.5 | -1.0 | -8.5 | 46.9 |
| 금융투자 | -36.9 | -40.1 | -77.0 | 0.0 | 1.7 | 59.1 | -13.3 | -0.8 | -6.5 | 13.7 |
| 투신 | -2.9 | 9.9 | 7.1 | -3.1 | -14.1 | -59.0 | -1.2 | -0.4 | -0.1 | -17.1 |
| 은행+보험+기타금융 | 14.4 | 4.6 | 19.1 | 0.0 | -3.4 | -14.9 | 0.0 | 0.1 | -2.0 | 0.0 |
| 연기금+국가지자체 | -47.6 | -1.8 | -49.4 | 9.5 | -10.0 | -2.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 50.3 |
| 기타법인 | 20.1 | -0.9 | 19.3 | 0.0 | -0.2 | 35.7 | -1.9 | 0.0 | -0.7 | -1.3 |

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 | 844,499 | 242.7 | 1,083,161 | 18.8% | 지수옵션 전체 | 1,829,892 | 493.4 | 2,483,937 |
| Put | 985,393 | 250.7 | 1,400,776 | 20.8% | PCR(금액기준) | 1.03 | VKOSPI | 21.21%(-1.29%p) |
| <hr/> | | | | | | | | |
| | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | |
| Call | 322.5(K+3) | 3.41 | 0.70 | 45,045 | 13,645 | 640 | 18.8 | 317.5(K+1) |
| | 320.0(K+2) | 4.53 | 0.73 | 28,077 | 14,514 | 92 | 19.2 | 315.0(K+0) |
| | 317.5(K+1) | 5.83 | 1.02 | 11,766 | 6,645 | 489 | 19.5 | 312.5(K-1) |
| | 315.0(K+0) | 7.30 | 1.03 | 7,947 | 5,640 | -333 | 19.8 | 310.0(K-2) |
| | 312.5(K-1) | 8.97 | 1.36 | 1,662 | 3,249 | 25 | 20.2 | 307.5(K-3) |
| | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | |
| Put | 317.5(K+1) | 4.91 | -1.67 | 5,610 | 10,001 | 324 | 19.6 | 315.0(K+0) |
| | 315.0(K+0) | 3.89 | -1.51 | 21,611 | 17,981 | -257 | 20.0 | 312.5(K-1) |
| | 312.5(K-1) | 3.04 | -1.36 | 12,397 | 7,320 | 275 | 20.3 | 310.0(K-2) |
| | 310.0(K-2) | 2.38 | -1.19 | 38,095 | 20,444 | 1,386 | 20.8 | 307.5(K-3) |
| | 307.5(K-3) | 1.83 | -1.03 | 37,476 | 10,307 | 607 | 21.2 | |

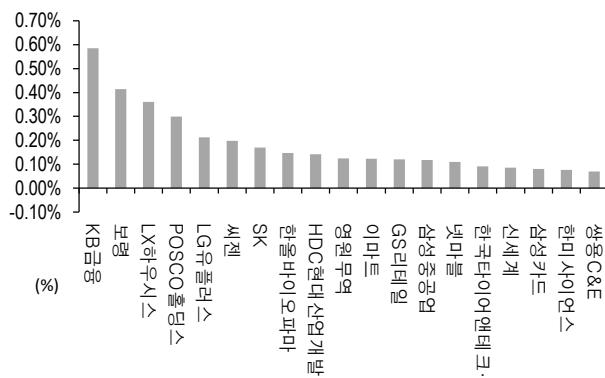
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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 | 3,255,225 | 2,076.2 | 4,546,031 | -30,114 | -45,987 | -26,568 | 73,820 | -16.0 | -29.6 | 46.9 |
| 종목명 | 선물현재가(원) | 등락률(%) | 선물거래대금(십억원) | 선현배율(%) | 미결제수량(계약) | 미결제증감(계약) | 평균괴리율(%) | 외국인순매수 | 개인순매수 | 기관순매수 |
| 삼성전기 | 135,500 | 0.00 | 59.1 | 132.7 | 32,034 | -1,185 | -0.11% | -2,011 | 284 | 1,727 |
| 삼성전자 | 59,000 | 0.34 | 736.3 | 92.8 | 1,304,159 | -41,037 | 0.04% | 7,281 | -41,052 | 34,428 |
| 호텔신라 | 70,600 | 0.28 | 8.6 | 89.4 | 12,078 | 34 | 0.00% | -272 | 89 | 133 |
| 현대차 | 184,500 | 1.10 | 159.3 | 84.2 | 47,660 | -6,295 | -0.03% | 1,006 | -6,837 | 5,801 |
| BGF | 4,180 | 1.70 | 0.6 | 82.3 | 6,169 | -299 | -0.12% | -1,084 | 67 | 1,017 |
| 현대제철 | 33,350 | 0.60 | 11.0 | 72.1 | 21,892 | 1,460 | 0.02% | 698 | 704 | -1,402 |
| JW 중외제약 | 22,450 | -0.22 | 1.1 | 70.9 | 2,929 | 58 | -0.05% | 51 | 93 | -144 |
| 넥센타이어 | 5,500 | 0.00 | 0.4 | 64.2 | 8,203 | -394 | -0.24% | -516 | -156 | 672 |
| 한샘 | 65,500 | 1.71 | 2.1 | 62.1 | 2,531 | 135 | -0.27% | 224 | -277 | 53 |
| 현대건설 | 39,450 | 3.14 | 12.9 | 61.0 | 13,511 | -1,735 | -0.08% | -3,220 | -723 | 3,943 |

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터