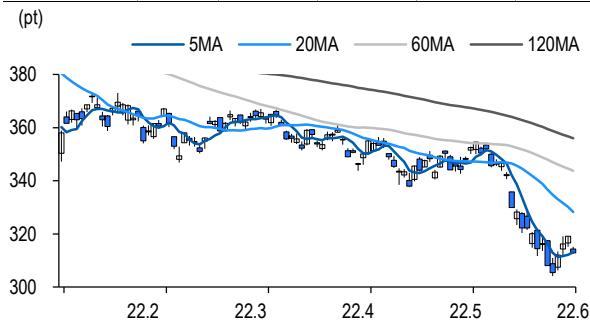


선물옵션시장 지표

2022.6.30

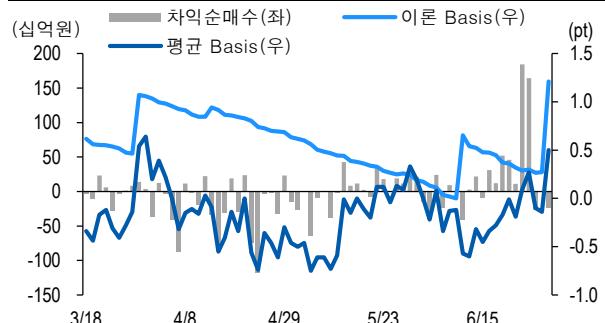
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.86	-1.96	-6.25	6,131.9	-
선물 9월물	313.30	-1.77	-5.65	21,737.8	305,480
선물 12월물	314.10	-1.75	-5.60	32.6	18,185
7월물(mini)	312.88	-1.74	-5.54	1,834.0	97,145
8월물(mini)	313.14	-1.80	-5.74	10.3	14,269



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.21	0.50	0.44	-0.23%
베이시스(mini)	0.26	0.04	0.02	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.86	0.79	0.75	-0.02%
합성선물 베이시스(ATM)	0.26	0.14	0.14	-0.04%



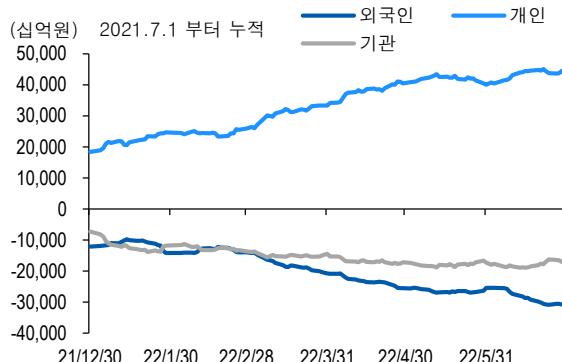
투자주체별 매매 동향

(십억원)

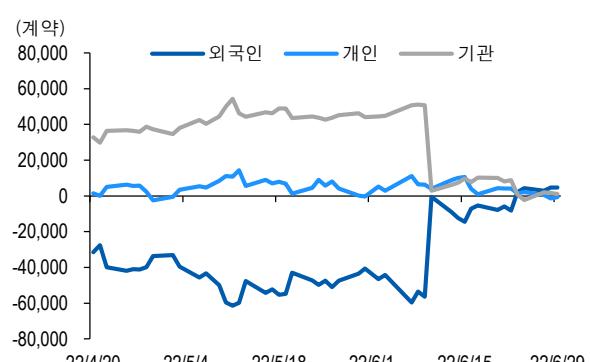
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-227.0	42.7	-184.3	-10.2	-264.5	-75.6	69.8	0.7	5.0	8.7
개인	694.1	25.8	719.9	0.0	-0.1	121.8	-66.3	-0.2	0.6	-35.7
기관	-504.6	-68.8	-573.4	-13.4	1.2	-26.9	-5.1	-0.5	-6.2	26.1
금융투자	-407.3	-69.9	-477.3	-2.4	-0.7	298.9	-2.8	-0.6	-5.2	82.3
투신	-20.6	2.3	-18.3	0.0	-11.4	-383.2	-1.8	-0.1	0.0	-6.0
은행+보험+기타금융	4.8	16.5	21.3	0.0	21.2	23.4	-0.5	0.2	-0.9	0.0
연기금+국가지자체	-40.0	0.5	-39.4	-12.6	0.6	34.0	0.0	0.0	0.0	-50.3
기타법인	37.5	0.3	37.8	0.0	0.0	-19.3	1.6	0.0	0.7	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
Call	836,996	184.9	1,094,776	18.5%	지수옵션 전체	1,669,568	434.0
Put	832,572	249.1	1,433,085	20.7%	PCR(금액기준)	1.35	VKOSPI 22.46%(+1.25%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	0.74	-1.03	85,870	19,978	-847	18.4	Put	322.5(K+1)	11.20	3.70	636	7,248	39	19.8
	325.0(K+2)	1.12	-1.39	95,271	20,276	575	18.6		320.0(K+0)	9.35	3.26	4,413	15,652	-88	19.8
	322.5(K+1)	1.64	-1.77	58,836	15,026	1,381	18.8		317.5(K-1)	7.79	2.88	3,056	10,409	408	20.2
	320.0(K+0)	2.35	-2.18	38,116	15,636	1,122	19.1		315.0(K-2)	6.36	2.47	12,677	18,525	544	20.5
	317.5(K-1)	3.21	-2.62	13,630	7,518	873	19.4		312.5(K-3)	5.12	2.08	7,936	7,799	479	20.8

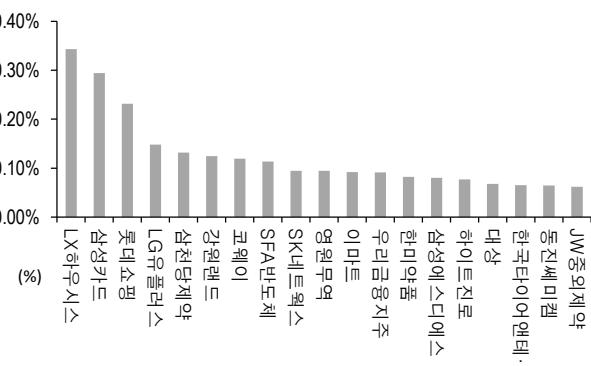
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,284,839	2,316.0	4,531,252	-14,779	23,983	-65,890	41,773	8.7	-35.7	26.1

종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수
삼성전기	132,500	-2.21	39.1	91.0	32,742	708	-0.14%	1,427	832	-2,259	-1,413	-536
BGF	4,220	0.96	0.4	84.3	6,007	-162	-0.17%	332	9	-341	-303	0
삼성전자	58,100	-1.53	655.8	80.9	1,288,341	-15,818	-0.04%	2,553	-36,571	33,930	87,570	-53,728
현대차	175,000	-5.15	331.7	74.1	47,680	20	-0.11%	677	-5,253	4,480	7,327	-2,730
현대위아	55,800	-2.28	6.4	71.7	4,751	126	0.01%	188	170	-358	-337	-21
카카오	70,900	-0.70	57.2	68.5	60,693	-3,518	-0.02%	1,317	-2,709	1,402	383	-1,286
현대제철	32,700	-1.95	7.1	68.3	22,699	807	0.00%	2,125	-3,037	912	1,513	-601
일진마티리얼즈	74,500	-5.34	23.9	67.4	72,382	-1,505	-0.04%	-2,074	133	1,927	-438	2,365
한울바이오파마	16,400	0.00	1.0	60.8	8,388	922	-0.12%	1,295	213	-1,508	-1,508	0
한국조선해양	91,600	0.33	8.6	59.7	6,029	98	-0.04%	-769	266	503	153	350

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터