

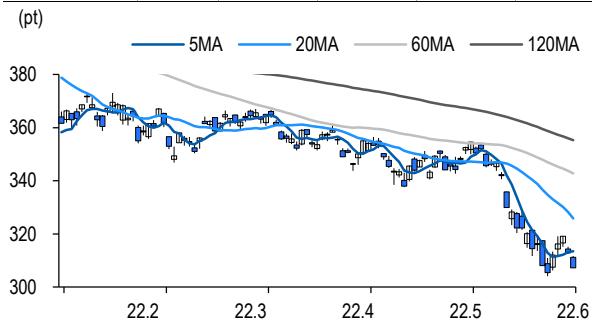


선물옵션시장 지표

2022.7.1

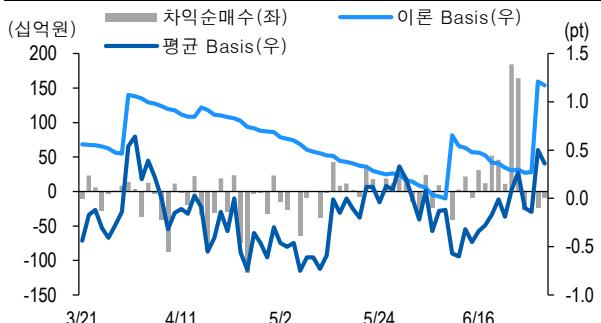
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	307.20	-1.81	-5.66	6,729.9	-
선물 9월물	307.45	-1.87	-5.85	26,301.0	313,343
선물 12월물	308.10	-1.91	-6.00	29.4	18,352
7월물(mini)	307.10	-1.85	-5.78	2,370.3	106,965
8월물(mini)	307.10	-1.93	-6.04	8.3	14,388



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.17	0.36	0.25	-0.26%
베이시스(mini)	0.24	0.00	-0.10	-0.08%
제1스프레드(SP)	0.85	0.74	0.75	-0.04%
합성선물 베이시스(ATM)	0.24	-0.15	-0.15	-0.13%



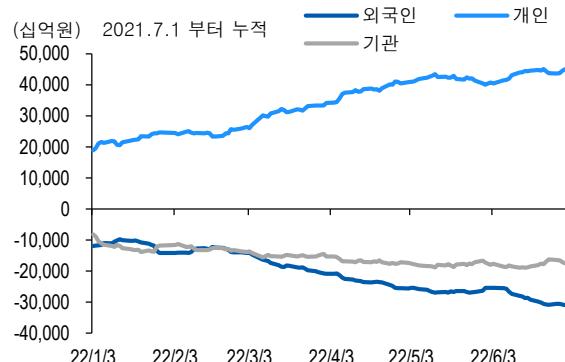
투자주체별 매매 동향

(십억원)

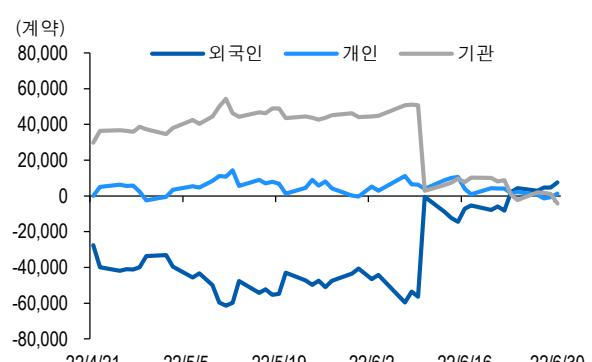
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-233.5	6.3	-227.3	-14.1	-466.6	25.8	195.4	6.5	-7.4	-15.2
개인	520.9	48.2	569.1	0.0	-1.7	164.0	-8.4	-1.9	6.7	-21.1
기관	-320.4	-62.7	-383.1	4.4	20.0	-232.5	-180.0	-4.3	0.1	37.4
금융투자	-236.9	-80.1	-317.0	-3.2	0.8	98.2	-180.3	-4.1	0.2	62.3
투신	4.3	-10.3	-6.0	0.0	5.9	-271.6	-0.1	-0.3	-0.1	-13.6
은행+보험+기타금융	20.4	35.1	55.6	0.0	12.7	-32.1	0.4	0.0	0.1	0.0
연기금+국가지자체	-1.8	0.3	-1.5	7.6	6.4	-27.0	0.0	0.0	0.0	-11.2
기타법인	33.0	8.2	41.2	0.0	0.0	42.8	-7.0	-0.3	0.6	-1.1

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	1,052,301	232.8	1,152,346	19.5%	지수옵션 전체	1,949,289	543.1	2,608,019
Put	896,988	310.3	1,455,673	22.7%	PCR(금액기준)	1.33	VKOSPI	23.90% (+1.44%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	320.0(K+3)	1.00	-1.35	113,355	19,311	3,675	19.4	315.0(K+1)
	317.5(K+2)	1.50	-1.71	65,184	9,915	2,397	19.8	312.5(K+0)
	315.0(K+1)	2.15	-2.15	32,784	10,448	4,329	20.1	310.0(K-1)
	312.5(K+0)	2.99	-2.56	14,094	4,963	1,641	20.4	307.5(K-2)
	310.0(K-1)	3.96	-3.07	11,446	6,237	1,831	20.6	305.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	315.0(K+1)	10.00	3.64	10,763	19,237	712	21.5	312.5(K+0)
	312.5(K+0)	8.44	3.32	7,736	7,893	94	22.2	310.0(K-1)
	310.0(K-1)	6.89	2.82	18,852	21,732	1,503	22.2	307.5(K-2)
	307.5(K-2)	5.60	2.39	14,481	11,073	487	22.5	305.0(K-3)
	305.0(K-3)	4.50	2.02	35,754	14,927	23	22.8	

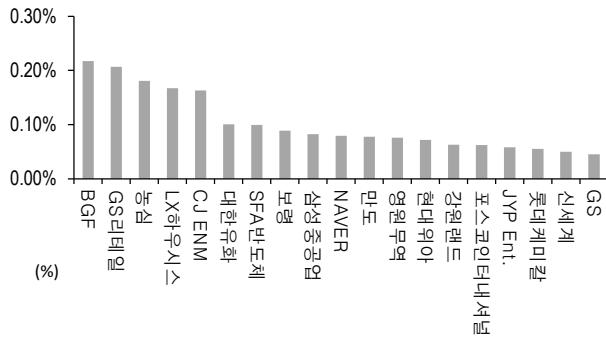
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	3,692,207	2,456.3	4,486,255	-44,997	-51,875	1,240	51,660	-15.2	-21.1	37.4	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
넥센타이어	5,380	-1.10	0.9	160.3	6,771	-743	0.02%	-397	-218	615	615
삼성전기	130,500	-1.51	69.0	103.0	31,380	-1,362	-0.13%	-1,010	-1,033	2,043	576
한국금융지주	61,000	-2.24	6.8	87.5	29,126	-244	-0.01%	-7	-98	105	-1
현대제철	32,250	-1.38	8.1	75.3	21,329	-1,370	0.03%	-2,858	3,332	-474	-603
삼성전자	57,200	-1.55	799.9	75.2	1,268,777	-19,564	0.01%	-20,053	39,168	-18,159	9,807
현대차	179,500	2.57	204.3	68.5	45,993	-1,687	-0.10%	5,306	-3,445	-1,798	-3,312
만도	47,550	-0.52	6.8	63.8	8,107	-65	0.08%	769	-133	-636	-1,655
현대위아	56,100	0.54	4.9	62.0	5,128	377	0.07%	935	-345	-603	-163
일진머티리얼즈	69,600	-6.58	38.8	56.9	63,321	-9,061	-0.42%	-2,129	-14,244	16,356	14,942
GS	41,800	-2.34	4.8	54.2	24,191	424	0.05%	68	107	-154	-174

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터