

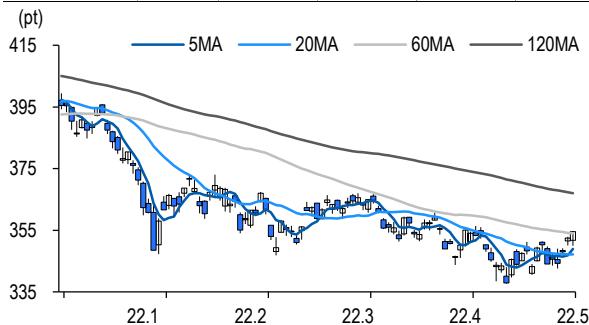


## 선물옵션시장 지표

2022.6.2

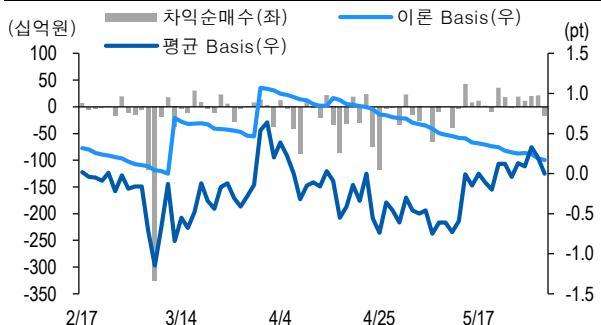
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	354.54	0.58	2.05	11,066.5	-
선물 6월물	354.15	0.34	1.20	20,870.5	292,368
선물 9월물	354.40	0.40	1.40	337.1	18,424
6월물(mini)	354.20	0.35	1.40	1,626.6	62,999
7월물(mini)	353.64	0.39	1.36	20.7	10,841



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.17	0.00	-0.39	-0.05%
베이시스(mini)	0.17	0.00	-0.34	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.73	0.17	0.15	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.17	-0.33	-0.33	-0.14%



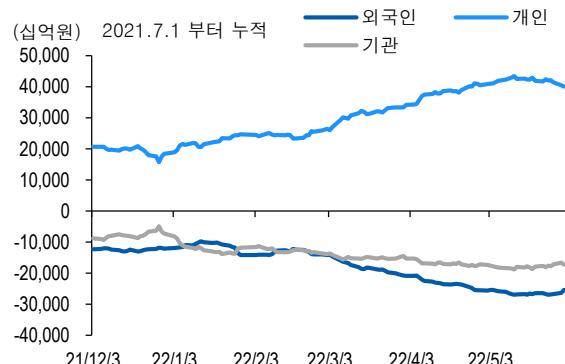
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

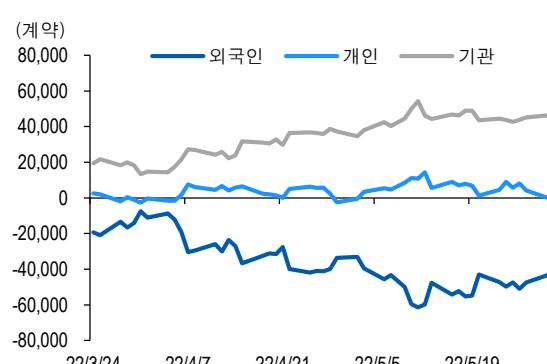
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	1,058.6	-44.7	1,013.8	-7.7	1,125.7	200.8	51.6	1.0	-0.8	1.2
개인	-509.1	50.3	-458.8	0.0	1.2	4.5	-48.8	0.1	0.1	37.5
기관	-585.2	-16.1	-601.3	-7.9	25.0	-177.7	-2.3	-1.4	1.1	-39.0
금융투자	-572.2	-41.1	-613.2	9.7	8.8	-44.3	-2.0	-1.8	1.2	-70.2
투신	8.2	-3.2	5.0	0.0	-3.0	-190.0	0.1	0.0	0.0	-8.4
은행+보험+기타금융	-14.3	36.0	21.7	0.0	-2.3	40.3	-0.4	0.4	-0.1	0.1
연기금+국가지자체	-5.2	-3.8	-9.1	-17.5	31.6	16.2	0.0	0.0	0.0	39.6
기타법인	35.7	10.5	46.2	0.0	-0.2	-27.6	-0.5	0.2	-0.4	0.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



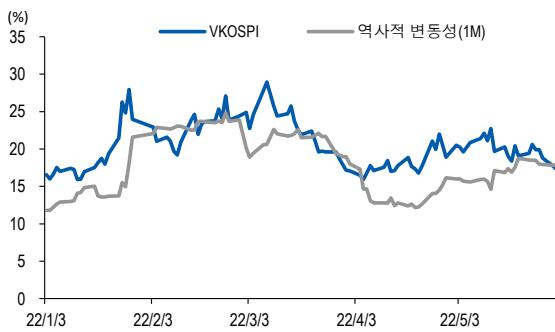
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

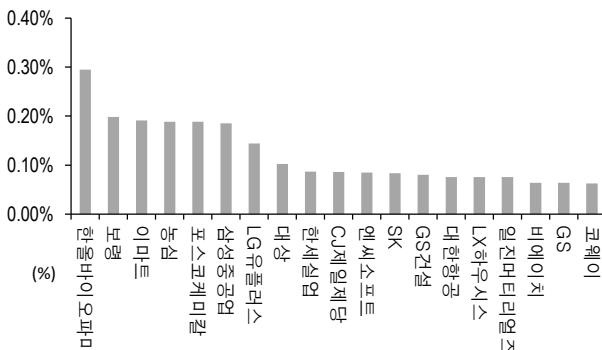
### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	828,905	227.1	899,300	12.6%	지수옵션 전체	1,926,445	445.0	2,522,337
Put	1,097,540	217.9	1,623,037	16.4%	PCR(금액기준)	0.96	VKOSPI	17.26%(-0.48%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	360.0(K+3)	1.05	0.19	203,389	54,883	-2,577	12.6	Put
	357.5(K+2)	1.82	0.33	132,635	20,273	-740	12.8	355.0(K+1)
	355.0(K+1)	2.92	0.44	90,318	23,577	-628	13.0	352.5(K+0)
	352.5(K+0)	4.31	0.55	38,742	14,081	-416	13.1	350.0(K-1)
	350.0(K-1)	6.05	0.77	11,225	21,010	-581	13.5	347.5(K-2)
<hr/>								
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터								

### 역시적 변동성과 VKOSPI



### 주식선물 평균베이시스 괴리율



### 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	3,287,044	2,438.2	4,443,463	69,144	18,553	68,270	-87,923	1.2	37.5	-39.0	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
삼성전자	67,300	-0.74	955.9	60.6	1,138,627	6,021	0.02%	20,766	21,140	-43,582	-41,101
넥센타이어	6,270	0.32	0.7	56.4	20,025	4,161	-0.61%	1,458	-24	-1,434	2,566
LG 이노텍	383,000	0.79	43.5	51.5	9,682	-424	-0.03%	-139	-315	452	-216
일진마티리얼즈	90,000	7.53	62.6	49.3	78,948	5,373	0.08%	1,107	7,060	-8,096	-4,707
SK 하이닉스	107,500	0.94	174.3	40.9	167,941	-4,530	-0.19%	2,472	-4,141	1,769	2,755
한화솔루션	38,850	5.71	75.3	36.7	35,549	8,862	-0.03%	-2,456	3,498	-1,046	-6,163
현대차	189,000	0.80	59.3	34.6	46,117	-1,557	-0.08%	-681	-203	879	-1,042
삼성전기	155,000	0.65	42.9	34.3	34,580	-1,860	0.02%	1,124	1,548	-2,672	-2,220
OCI	129,500	1.17	42.8	33.9	13,098	1,457	0.01%	-147	937	-790	192
와이즈엔터	56,700	0.53	2.6	32.8	8,769	667	0.01%	156	254	-510	-504