

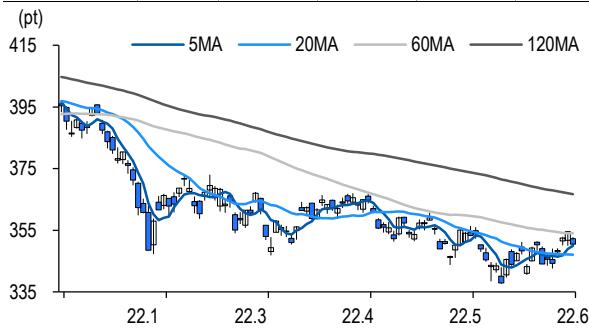


선물옵션시장 지표

2022.6.3

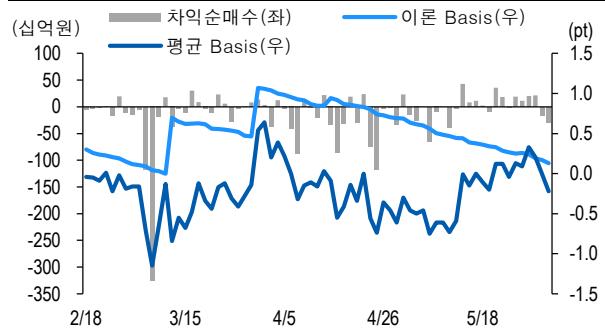
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	350.51	-1.14	-4.03	5,796.0	-
선물 6월물	350.00	-1.17	-4.15	19,266.1	290,464
선물 9월물	350.00	-1.24	-4.40	467.8	21,893
6월물(mini)	350.08	-1.15	-4.12	1,532.2	64,253
7월물(mini)	349.68	-1.12	-3.96	28.8	12,734



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.13	-0.22	-0.51	-0.10%
베이시스(mini)	0.13	-0.22	-0.43	-0.10%
제1스프레드(SP)	0.71	0.15	0.10	-0.16%
합성선물 베이시스(ATM)	0.13	-0.38	-0.38	-0.15%



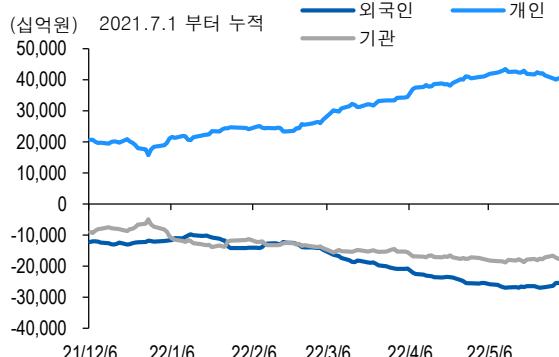
투자주체별 매매 동향

(십억원)

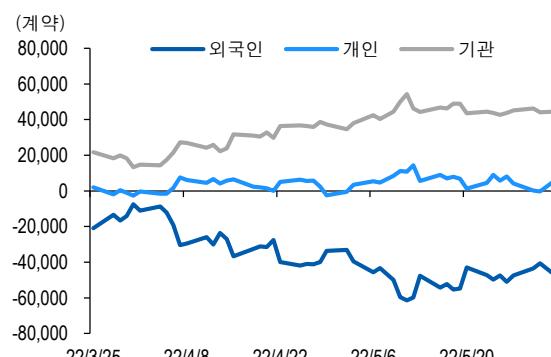
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-87.7	42.6	-45.2	-10.3	33.6	-470.7	-61.3	-1.7	6.0	-39.6
개인	793.4	-63.1	730.4	0.0	0.9	405.7	83.0	1.4	-4.0	41.9
기관	-748.9	17.8	-731.0	-18.7	-4.4	59.7	-29.1	1.2	-1.0	-1.5
금융투자	-669.1	10.0	-659.1	-2.8	-19.1	390.0	-28.9	1.2	-1.0	19.8
투신	-24.8	0.4	-24.3	0.0	-11.0	-354.6	0.0	0.0	0.0	-30.3
은행+보험+기타금융	-12.8	-1.1	-13.9	0.0	-2.6	6.9	-0.1	0.0	0.0	0.1
연기금+국가지자체	3.0	3.5	6.5	-14.1	32.6	17.4	0.0	0.0	0.0	8.9
기타법인	43.2	2.6	45.8	0.0	-0.6	5.2	7.4	-0.8	-1.0	-0.8

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

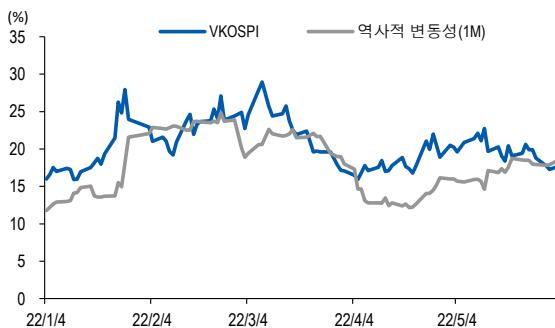
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	751,370	151.5	944,314	12.8%	지수옵션 전체	1,702,495	379.3	2,619,450
Put	951,125	227.8	1,675,136	16.0%	PCR(금액기준)	1.50	VKOSPI	17.60%(+0.34%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	362.5(K+3)	0.10	-0.43	77,419	31,306	3,992	12.6	357.5(K+1)
	360.0(K+2)	0.25	-0.80	147,648	57,969	3,086	12.8	355.0(K+0)
	357.5(K+1)	0.50	-1.32	118,770	24,415	4,142	12.5	352.5(K-1)
	355.0(K+0)	1.07	-1.85	134,623	29,737	6,160	13.0	350.0(K-2)
	352.5(K-1)	1.85	-2.46	71,436	15,920	1,839	12.9	347.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	357.5(K+1)	7.94	2.66	1,395	1,698	42	16.8	
	355.0(K+0)	5.94	2.20	6,458	5,514	41	16.0	
	352.5(K-1)	4.26	1.66	24,211	8,049	319	15.7	
	350.0(K-2)	2.93	1.18	57,682	23,428	118	15.7	
	347.5(K-3)	1.96	0.73	92,151	14,528	1,819	16.0	

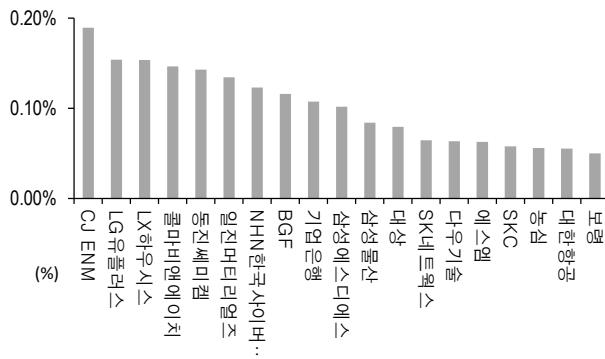
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,758,442	1,984.7	4,466,715	23,252	-110,324	50,867	59,975	-39.6	41.9	-1.5
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
LG 이노텍	389,000	1.57	64.2	72.3	8,915	-767	-0.08%	-685	-45	729
SK 하이닉스	107,000	-0.47	214.4	65.5	167,028	-913	-0.01%	416	1,450	-1,866
호텔신라	77,100	-1.41	6.7	64.9	10,029	-380	-0.08%	-767	446	311
삼성전기	149,500	-3.55	86.7	60.7	41,012	6,432	-0.08%	-6,192	7,851	-1,671
메리츠증권	6,130	1.16	5.9	59.0	64,843	-8,034	0.05%	567	-12,751	12,086
현대차	187,500	-0.79	42.6	58.7	45,604	-513	-0.04%	626	416	-689
일진미터리얼즈	88,200	-2.00	22.3	54.2	81,062	2,114	0.13%	46	3,539	-3,546
현대위아	65,900	-0.75	3.5	50.0	6,089	-160	-0.04%	-155	15	140
기아	84,600	-0.82	56.7	49.6	61,255	1,665	-0.03%	3,447	-3,510	803
엔씨소프트	456,500	0.44	19.5	49.3	9,862	113	0.00%	171	-15	-156

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터