

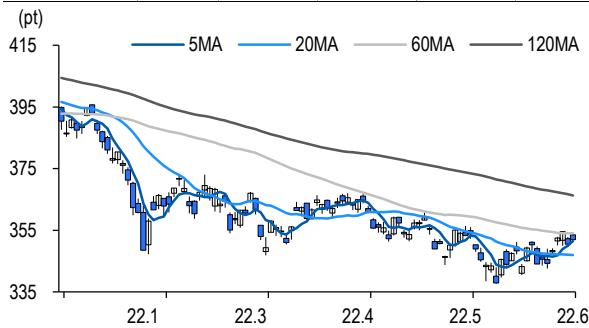


## 선물옵션시장 지표

2022.6.7

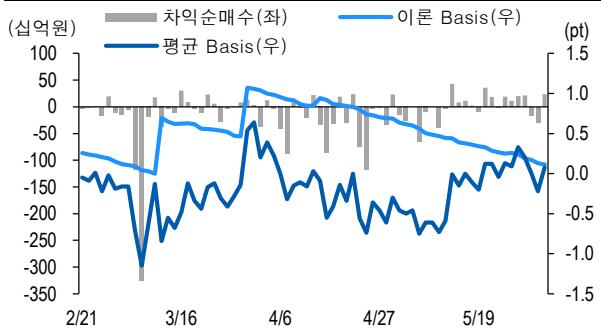
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	352.01	0.43	1.50	4,735.1	-
선물 6월물	352.40	0.69	2.40	17,576.6	268,736
선물 9월물	352.40	0.69	2.40	899.7	49,457
6월물(mini)	352.38	0.68	2.30	1,497.8	64,655
7월물(mini)	351.80	0.61	2.12	11.8	15,481



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.11	0.08	0.39	-0.01%
베이시스(mini)	0.11	0.08	0.37	-0.01%
제1스프레드(SP)	0.72	0.07	0.05	-0.19%
합성선물 베이시스(ATM)	0.11	0.38	0.38	0.08%



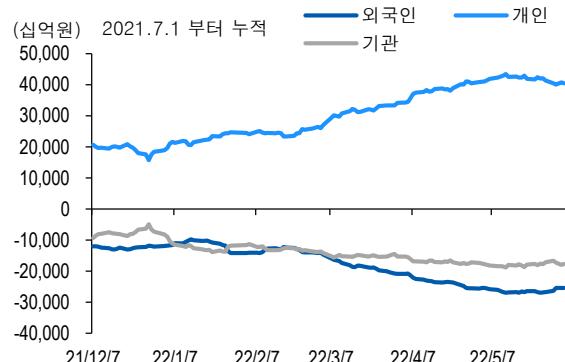
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

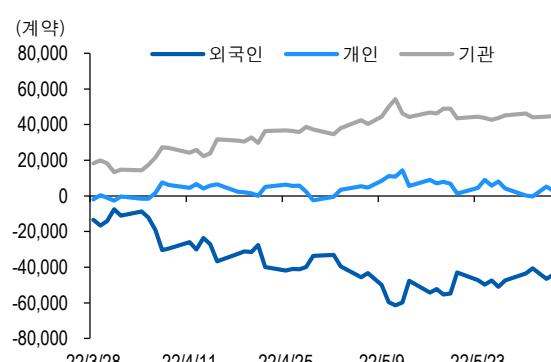
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-13.0	55.6	42.6	-0.3	-43.0	211.1	-1.0	0.4	-1.0	-5.4
개인	-310.0	-17.2	-327.2	0.0	0.3	-210.7	-4.8	-1.0	-1.1	14.4
기관	322.4	-39.2	283.3	24.4	-23.1	28.8	5.6	0.5	2.0	-8.6
금융투자	213.9	-31.7	182.3	6.7	-13.5	-270.2	7.1	0.5	2.3	-1.3
투신	5.7	9.8	15.4	0.0	6.9	330.0	-1.5	0.0	-0.1	11.9
은행+보험+기타금융	-8.8	-14.1	-22.9	0.0	-14.3	-14.4	0.0	0.0	-0.2	-0.1
연기금+국가지자체	64.3	-0.7	63.6	17.6	-1.0	-16.6	0.0	0.0	0.0	-19.1
기타법인	0.6	0.8	1.4	0.0	0.1	-29.1	0.2	0.1	0.1	-0.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



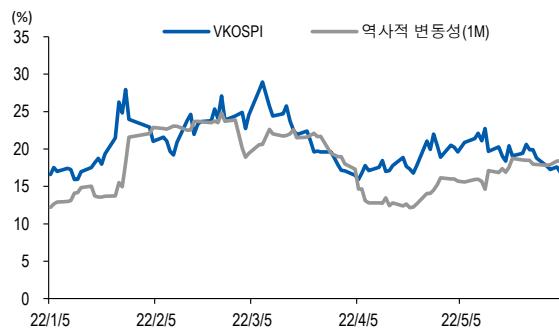
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정				
Call	1,071,799	241.0	985,264	12.9%	지수옵션 전체		2,289,119	458.3	2,705,681			
Put	1,217,320	217.3	1,720,417	14.3%	PCR(금액기준)		0.90	VKOSPI	16.87%(-0.73%p)			
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	Put	행사가	종가	등락(pt)	
	357.5(K+3)	0.68	0.18	235,300	26,738	2,323	12.7		352.5(K+1)	2.61	-1.65	55,313
	355.0(K+2)	1.37	0.30	188,865	28,656	-1,081	13.0		350.0(K+0)	1.63	-1.30	127,580
	352.5(K+1)	2.52	0.67	87,471	15,473	-447	13.9		347.5(K-1)	0.97	-0.99	160,983
	350.0(K+0)	4.02	0.95	22,114	22,403	-214	14.5		345.0(K-2)	0.56	-0.70	177,442
	347.5(K-1)	5.90	1.35	7,594	7,446	-206	15.7		342.5(K-3)	0.32	-0.47	137,359

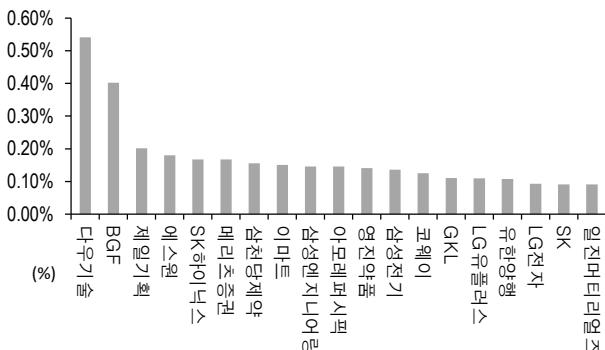
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	2,504,405	1,964.0	4,611,656	144,941	-1,746	26,325	-25,007	-5.4	14.4	-8.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK 하이닉스	106,500	-0.47	146.2	83.6	149,954	-17,074	0.17%	-8,954	5,630	3,324
LG 이노텍	388,500	-0.13	40.9	78.3	8,559	-356	0.00%	186	-302	116
삼성전자	67,000	0.45	384.8	70.1	941,797	-120,485	0.03%	-17,722	33,514	-15,936
일진마티리얼즈	87,300	-1.02	21.5	60.4	77,919	-3,143	0.09%	1,135	-383	-752
한국금융지주	71,000	1.43	3.6	57.5	15,275	-3,423	0.03%	-151	-392	569
현대차	186,500	-0.53	42.7	57.4	44,799	-805	0.06%	-1,255	77	978
하나금융지주	47,650	0.32	13.9	54.8	72,738	-4,861	0.07%	2,674	-62	-2,612
LG 화학	586,000	2.45	91.7	53.3	8,119	275	0.01%	423	-296	-146
POSCO 홀딩스	289,500	0.35	34.0	49.1	11,742	-4,186	0.02%	296	266	-561
OCI	132,500	4.33	49.0	49.0	13,901	1,820	-0.10%	3,331	-2,191	-1,155

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터