

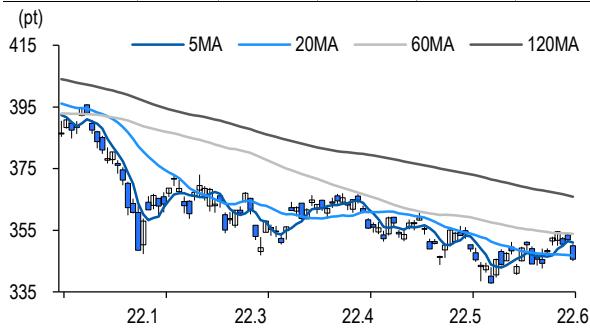


선물옵션시장 지표

2022.6.8

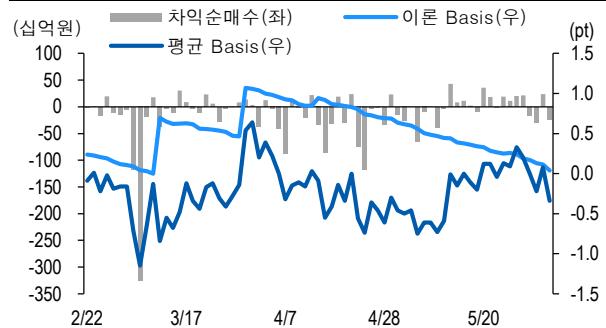
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	345.67	-1.80	-6.34	6,590.8	-
선물 6월물	345.70	-1.90	-6.70	19,175.4	174,916
선물 9월물	345.65	-1.92	-6.75	3,527.2	155,676
6월물(mini)	345.60	-1.93	-6.78	1,264.6	74,994
7월물(mini)	344.64	-2.04	-7.16	63.5	26,104



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.04	-0.34	0.03	-0.11%
베이시스(mini)	0.04	-0.34	-0.07	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.68	-0.11	-0.15	-0.23%
합성선물 베이시스(ATM)	0.04	-0.08	-0.08	-0.03%



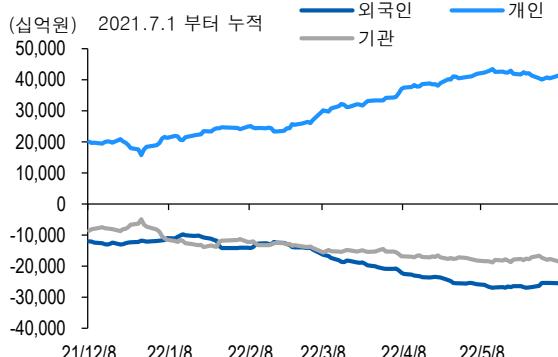
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-205.1	12.0	-193.1	-14.3	-128.0	-1,269.8	-75.2	-1.4	2.4	16.8
개인	992.2	85.7	1,077.8	0.0	-1.1	644.1	75.4	-0.1	-2.1	4.8
기관	-822.5	-96.3	-918.8	-9.2	-13.7	518.0	-7.8	2.0	0.1	-22.0
금융투자	-685.8	-96.5	-782.3	-2.0	-19.3	855.3	-8.3	1.6	0.9	-57.6
투신	-22.7	-2.4	-25.1	0.0	4.6	-354.2	-0.4	-0.3	0.2	-8.0
은행+보험+기타금융	-17.4	1.0	-16.3	0.0	1.2	2.8	0.9	0.7	-1.0	1.6
연기금+국가지자체	-38.8	-2.3	-41.1	-7.3	8.6	14.1	0.0	0.0	0.0	42.0
기타법인	35.4	-1.4	34.0	0.0	0.0	107.8	7.6	-0.5	-0.3	0.3

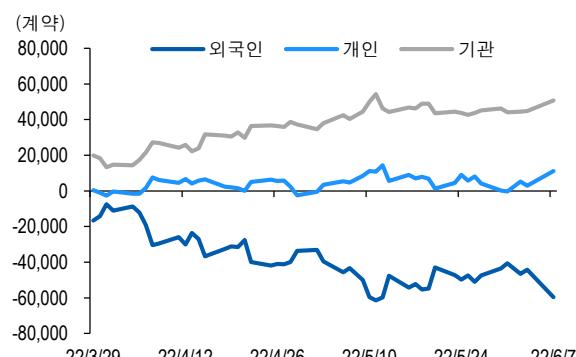
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

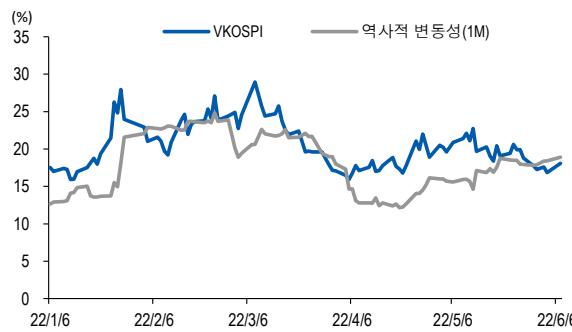


선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)															
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	1,476,512	217.1	1,090,751	16.2%	지수옵션 전체	3,083,505	581.2	2,847,984							
Put	1,606,993	364.1	1,757,233	17.7%	PCR(금액기준)	1.68	VKOSPI	18.10% (+1.23%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	360.0(K+3)	0.02	-0.26	117,231	65,968	4,321	19.1	Put	355.0(K+1)	9.44	5.41	5,386	5,923	-960	19.1
	357.5(K+2)	0.03	-0.65	172,399	44,647	17,909	17.1		352.5(K+0)	7.09	4.48	11,226	10,335	-1,077	17.8
	355.0(K+1)	0.07	-1.30	243,849	41,143	12,487	16.1		350.0(K-1)	5.04	3.41	52,259	23,907	-746	18.3
	352.5(K+0)	0.18	-2.34	300,482	35,967	20,494	15.3		347.5(K-2)	3.10	2.13	124,271	17,736	-1,278	16.7
	350.0(K-1)	0.50	-3.52	239,299	37,907	15,504	15.3		345.0(K-3)	1.85	1.29	234,535	27,275	-4,439	17.6

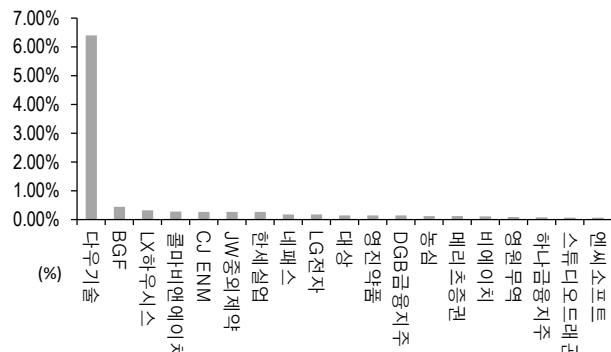
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,746,533	2,795.2	4,831,518	219,862	45,681	9,357	-56,124	16.8	4.8	-22.0
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
현대차	183,500	-1.61	80.0	69.8	45,427	628	-0.04%	1,576	675	-2,236
일진미티리얼즈	84,400	-3.32	20.1	66.8	54,990	-22,929	0.04%	-303	-1,193	1,496
SK 하이닉스	104,000	-2.35	208.4	63.5	151,392	1,438	-0.11%	-5,007	548	4,464
LG 전자	101,500	-1.93	39.9	59.3	44,764	-4,524	0.18%	-884	-1,452	2,354
기아	82,800	-0.84	40.2	55.5	52,550	-5,543	0.02%	3,312	2,681	-6,451
삼성전자	65,700	-1.94	677.4	53.3	708,662	-233,135	0.00%	3,012	13,754	-17,744
엔씨소프트	442,000	-1.56	17.7	50.8	8,876	-881	0.07%	407	-119	-288
POSCO 홀딩스	288,000	-0.52	35.0	49.9	10,674	-1,068	0.04%	484	62	-572
LG 이노텍	390,000	0.39	39.3	49.7	7,834	-725	0.01%	391	30	-395
신세계	254,000	-2.50	4.3	43.9	1,257	-55	0.02%	68	44	-112

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터