

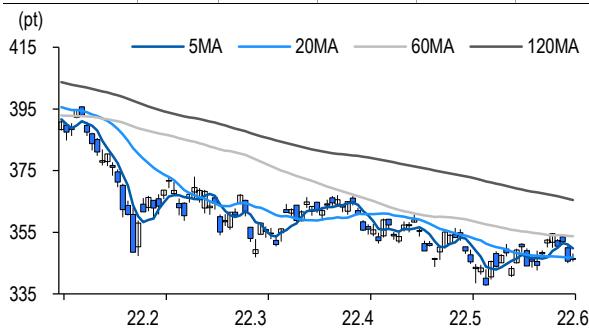


선물옵션시장 지표

2022.6.9

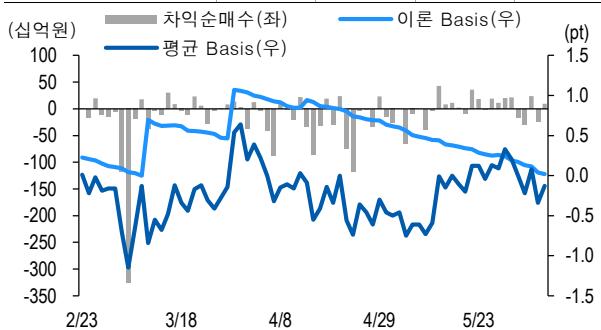
Market Data (십억원, 계약)

| | 종가(pt) | 등락률(%) | 등락폭(pt) | 거래대금 | 미결제 |
|-----------|--------|--------|---------|----------|---------|
| KOSPI200 | 346.22 | 0.16 | 0.55 | 5,477.9 | - |
| 선물 6월물 | 346.65 | 0.27 | 0.95 | 17,318.6 | 110,670 |
| 선물 9월물 | 346.40 | 0.22 | 0.75 | 4,908.6 | 226,591 |
| 6월물(mini) | 346.66 | 0.28 | 1.06 | 1,362.2 | 80,527 |
| 7월물(mini) | 346.04 | 0.41 | 1.40 | 127.7 | 36,310 |



차익거래 관련 Market data (pt)

| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) |
|----------------|------|-------|-------|--------|
| K200 베이시스 | 0.02 | -0.13 | 0.43 | -0.04% |
| 베이시스(mini) | 0.02 | -0.13 | 0.44 | -0.04% |
| 제1스프레드(SP) | 0.68 | -0.18 | -0.20 | -0.25% |
| 합성선물 베이시스(ATM) | 0.02 | 0.37 | 0.37 | 0.10% |



투자주체별 매매 동향

(십억원)

| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 |
|------------|--------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|
| 외국인 | -105.6 | -7.7 | -113.3 | -1.9 | 44.7 | 514.6 | 27.6 | -0.1 | -2.8 | 5.1 |
| 개인 | 139.5 | -18.2 | 121.3 | 0.0 | -1.0 | -362.9 | -33.9 | -0.4 | 0.9 | -17.9 |
| 기관 | -73.1 | 27.4 | -45.6 | 11.2 | -29.6 | 22.1 | 10.5 | 1.4 | 2.3 | 14.1 |
| 금융투자 | 10.6 | 62.8 | 73.4 | 0.7 | 2.2 | -119.5 | 11.0 | -0.1 | 4.4 | 16.6 |
| 투신 | -15.5 | -9.3 | -24.9 | 0.0 | 10.8 | 228.3 | 0.3 | -0.6 | 0.0 | 26.5 |
| 은행+보험+기타금융 | -19.9 | -7.3 | -27.1 | 0.0 | -5.8 | -69.8 | -0.8 | 2.1 | -2.1 | -0.6 |
| 연기금+국가지자체 | 28.0 | -3.3 | 24.7 | 10.4 | -13.6 | -16.9 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -28.4 |
| 기타법인 | 39.1 | -1.5 | 37.6 | 0.0 | -0.1 | -173.7 | -4.2 | -0.8 | -0.5 | -1.3 |

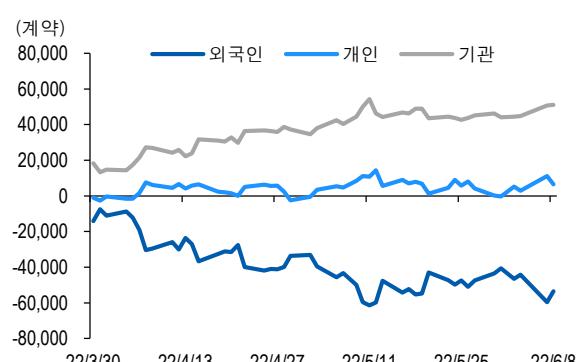
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

| | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | 대표변동성 | | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | | | | | | | |
|------|------------|-------|-----------|---------|-----------|-----------|--------|-----------------|------------|------|-------|---------|--------|--------|------|
| Call | 1,574,454 | 281.1 | 1,151,425 | 14.1% | 지수옵션 전체 | 3,282,229 | 558.4 | 2,999,907 | | | | | | | |
| Put | 1,707,775 | 277.3 | 1,848,482 | 13.8% | PCR(금액기준) | 0.99 | VKOSPI | 17.10%(-1.00%p) | | | | | | | |
| | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | | | | | | | | |
| Call | 352.5(K+3) | 0.05 | -0.13 | 381,791 | 49,629 | 13,662 | 13.4 | Put | 347.5(K+1) | 1.81 | -1.29 | 136,336 | 18,762 | 1,026 | 10.5 |
| | 350.0(K+2) | 0.25 | -0.25 | 439,572 | 46,509 | 8,602 | 13.5 | | 345.0(K+0) | 0.71 | -1.14 | 334,352 | 34,846 | 7,571 | 12.1 |
| | 347.5(K+1) | 0.95 | -0.17 | 362,047 | 23,380 | 5,463 | 14.5 | | 342.5(K-1) | 0.27 | -0.75 | 376,351 | 25,220 | 5,375 | 14.0 |
| | 345.0(K+0) | 2.30 | -0.10 | 120,973 | 21,476 | 3,593 | 15.6 | | 340.0(K-2) | 0.08 | -0.43 | 328,040 | 41,331 | 10,666 | 15.0 |
| | 342.5(K-1) | 4.40 | 0.38 | 14,864 | 5,566 | 630 | 19.5 | | 337.5(K-3) | 0.04 | -0.25 | 174,226 | 44,707 | 15,404 | 17.5 |

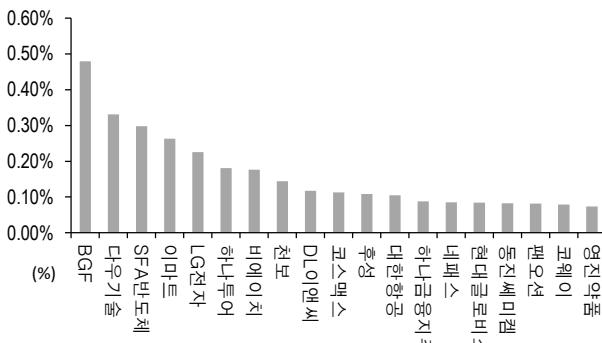
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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 | 2,959,654 | 2,399.6 | 4,906,413 | 74,895 | 2,525 | -7,727 | 5,960 | 5.1 | -17.9 | 14.1 |

| 종목명 | 선물현재가(원) | 등락률(%) | 선물거래대금(십억원) | 선현배율(%) | 미결제수량(계약) | 미결제증감(계약) | 평균괴리율(%) | 외국인순매수 | 개인순매수 | 기관순매수 | 금융투자순매수 | 연기금등순매수 |
|---------|----------|--------|-------------|---------|-----------|-----------|----------|--------|--------|--------|---------|---------|
| SK 하이닉스 | 106,000 | 1.92 | 237.0 | 74.5 | 135,853 | -15,539 | 0.06% | 4,402 | -248 | -4,098 | -3,408 | -7,000 |
| 코스맥스 | 68,700 | 0.73 | 2.6 | 73.1 | 3,714 | -1,371 | 0.11% | -624 | 75 | 553 | 553 | 0 |
| 삼성전자 | 65,500 | -0.30 | 565.8 | 70.7 | 543,176 | -165,486 | 0.05% | 9,797 | -9,397 | -525 | 3,747 | -29,207 |
| 일진머티리얼즈 | 83,400 | -1.18 | 16.0 | 66.7 | 38,492 | -16,498 | 0.04% | 954 | -892 | -60 | -230 | 160 |
| 현대차 | 183,500 | 0.00 | 61.0 | 59.9 | 38,568 | -6,859 | -0.03% | -1,490 | -164 | 1,534 | 1,239 | 884 |
| GS건설 | 37,700 | 0.00 | 8.4 | 55.0 | 23,846 | -4,872 | 0.04% | 603 | -391 | -212 | -322 | 110 |
| 씨젠 | 42,950 | 1.42 | 4.7 | 54.6 | 30,900 | -23,786 | -0.04% | -1,370 | 356 | 1,014 | 1,824 | 0 |
| LG 화학 | 579,000 | 3.58 | 86.7 | 53.2 | 6,323 | -1,608 | 0.03% | 673 | -1,163 | 528 | 572 | -23 |
| LG 이노텍 | 378,000 | -3.08 | 50.3 | 53.2 | 5,906 | -1,928 | 0.01% | 309 | -718 | 409 | 515 | 7 |
| 호텔신라 | 78,600 | 0.00 | 6.4 | 52.9 | 6,855 | -1,499 | -0.02% | -942 | 115 | 827 | 399 | 422 |

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터