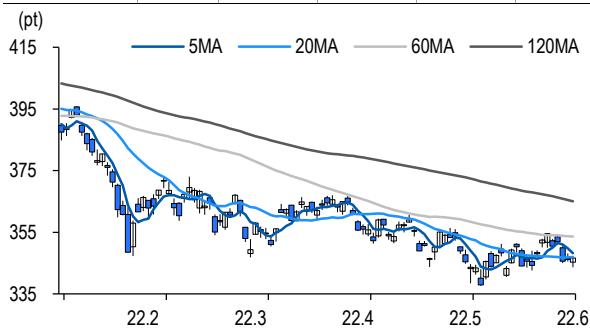


선물옵션시장 지표

2022.6.10

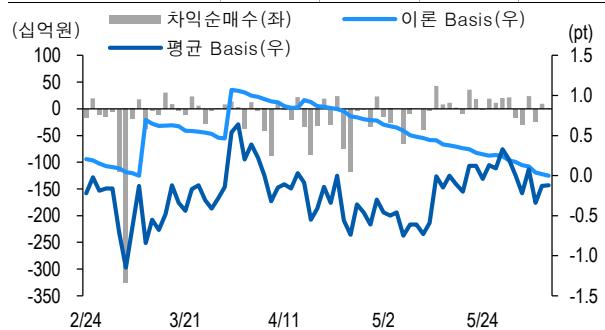
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	346.62	0.12	0.40	8,295.5	-
선물 6월물	345.50	-0.33	-1.15	13,576.3	0
선물 9월물	345.00	-0.40	-1.40	10,020.6	254,784
6월물(mini)	345.54	-0.32	-1.12	598.9	0
7월물(mini)	344.68	-0.39	-1.36	1,038.3	41,272



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.00	-0.12	-1.12	-0.03%
베이시스(mini)	0.00	-0.12	-1.08	-0.03%
제1스프레드(SP)	0.69	-0.13	-0.15	-0.24%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	-1.27	-1.27	-0.37%



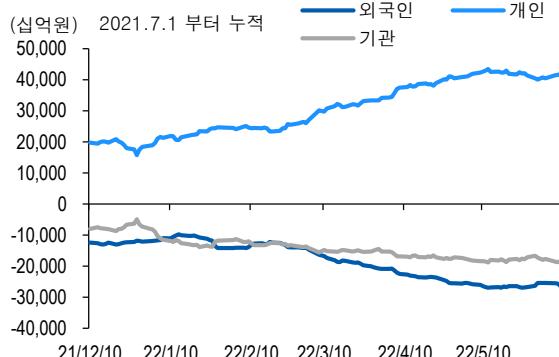
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-948.0	8.2	-939.8	-36.8	-443.1	-236.5	-9.2	2.1	-1.6	28.2
개인	372.7	42.9	415.7	0.0	0.7	-56.7	41.6	0.7	2.0	-18.5
기관	533.0	-59.2	473.9	37.9	157.7	2.9	-29.7	-1.6	0.8	-10.1
금융투자	625.0	-68.1	556.9	60.2	125.4	29.0	-31.3	1.1	1.0	64.2
투신	42.5	-4.4	38.1	0.0	16.7	4.9	-0.5	-2.0	0.1	-34.2
은행+보험+기타금융	7.1	11.9	19.0	0.0	10.4	-24.3	2.2	-0.7	-0.3	0.0
연기금+국가지자체	-113.4	1.7	-111.7	-20.8	6.0	-6.8	0.0	0.0	0.0	-40.1
기타법인	42.3	8.0	50.3	0.0	-0.3	290.3	-2.7	-1.2	-1.2	0.5

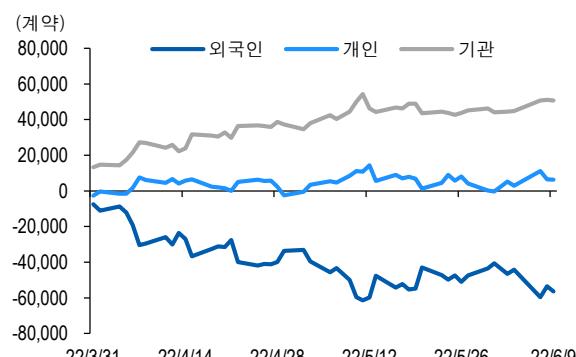
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



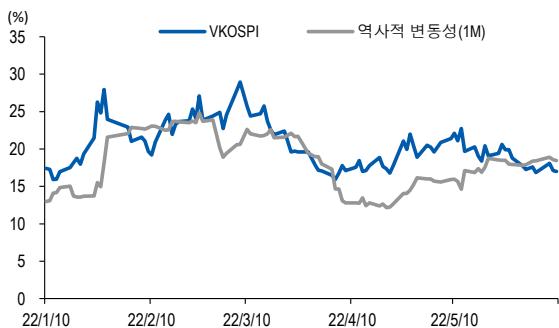
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,972,496	283.4	472,323	5.1%	지수옵션 전체	4,161,906	645.8	1,185,539
Put	2,189,410	362.4	713,216	13.8%	PCR(금액기준)	1.28	VKOSPI	17.00%(-0.10%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	352.5(K+3)	0.01	-0.04	44,278	0	-49,629	14.1	Put
	350.0(K+2)	0.01	-0.24	212,999	0	-46,509	8.7	
	347.5(K+1)	0.01	-0.94	704,401	0	-23,380	2.8	
	345.0(K+0)	0.55	-1.75	658,247	0	-21,476	4.2	
	342.5(K-1)	2.93	-1.47	162,544	0	-5,566	8.9	

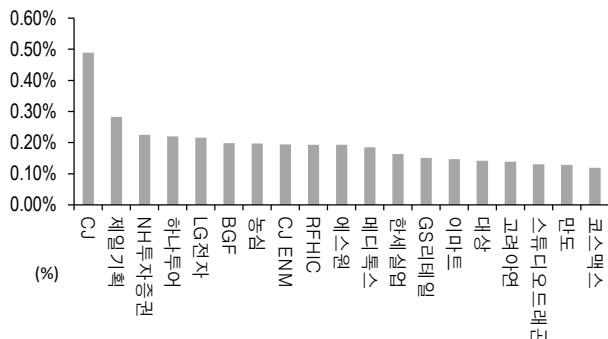
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,812,356	2,877.1	3,343,918	-1,562,495	48,573	20,272	-69,191	28.2	-18.5	-10.1
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	182,500	-0.54	46.5	39.0	0	-38,568	-0.15%	2,784	-1,318	-1,460
삼성전기	151,000	-0.33	73.5	31.9	0	-27,359	-0.10%	-4,810	-6,116	11,234
LG 이노텍	378,500	0.13	23.6	31.4	0	-5,906	-0.02%	444	-564	158
삼성전자	64,900	-0.92	493.7	29.8	0	-543,176	-0.07%	26,008	1,625	-28,744
GS건설	37,400	-0.80	8.2	28.8	0	-23,846	0.00%	1,990	-439	-1,701
씨젠	42,800	-0.35	3.5	27.0	0	-30,900	0.01%	-536	656	-120
SK 하이닉스	106,000	0.00	131.6	26.9	0	-135,853	-0.10%	10,226	-735	-9,663
OCI	132,000	-0.75	15.2	26.4	0	-10,705	-0.21%	326	882	-1,415
대한항공	28,500	-0.18	10.6	25.9	0	-60,567	0.02%	7,447	-8,429	1,065
셀트리온	164,000	1.55	19.5	25.0	0	-24,510	-0.21%	-379	-2,038	2,415

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터