

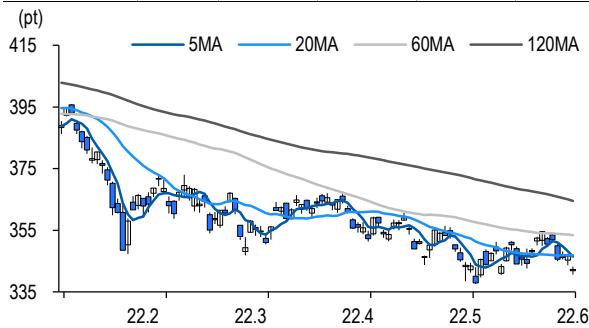


## 선물옵션시장 지표

2022.6.13

## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	341.89	-1.36	-4.73	6,181.3	-
선물 9월물	341.10	-1.13	-3.90	21,265.6	265,972
선물 12월물	341.75	-1.31	-4.55	68.8	16,429
7월물(mini)	340.84	-1.11	-3.84	1,795.4	45,221
8월물(mini)	341.10	-1.13	-3.90	21.6	3,835



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.65	-0.57	-0.79	-0.36%
베이시스(mini)	-0.35	-0.84	-1.05	-0.14%
제1스프레드(SP)	0.95	0.66	0.65	-0.08%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.35	-0.74	-0.74	-0.11%



## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-847.9	48.0	-799.8	-26.2	-479.9	-313.1	2.2	5.9	1.1	-23.3
개인	1,106.4	-25.2	1,081.2	0.0	-8.3	275.0	15.0	-2.9	-3.5	33.2
기관	-281.4	-33.7	-315.0	-15.1	-60.9	62.4	-11.8	-3.1	2.7	-9.8
금융투자	-257.9	-70.6	-328.6	-2.8	-2.6	135.0	-11.8	2.0	3.2	80.0
투신	-55.6	0.8	-54.8	0.0	-53.0	-52.9	0.0	-0.3	-0.4	-20.2
은행+보험+기타금융	2.1	28.5	30.6	0.0	-19.7	-31.0	0.0	-4.8	0.0	0.5
연기금+국가지자체	97.6	4.1	101.7	-11.9	31.2	11.3	0.0	0.0	0.0	-70.1
기타법인	22.8	10.8	33.7	0.0	-1.7	-24.3	-5.4	0.2	-0.3	-0.1

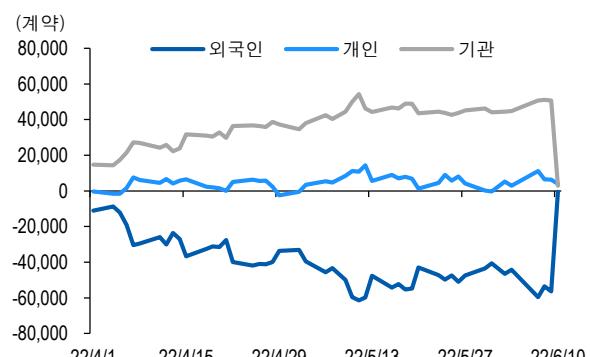
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	608,528	201.8	541,263	14.9%	지수옵션 전체	1,251,918	471.9	1,351,275
Put	643,390	270.1	810,012	17.5%	PCR(금액기준)	1.34	VKOSPI	18.29%(+1.29%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	355.0(K+3)	1.79	-0.72	71,274	14,899	5,792	14.8	350.0(K+1)
	352.5(K+2)	2.35	-0.91	52,181	5,795	2,793	14.9	347.5(K+0)
	350.0(K+1)	3.18	-0.97	28,027	7,580	1,780	15.4	345.0(K-1)
	347.5(K+0)	4.00	-1.26	12,913	3,454	1,507	15.4	342.5(K-2)
	345.0(K-1)	5.11	-1.34	8,280	4,011	1,323	15.8	340.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	350.0(K+1)	12.00	2.50	698	4,674	208	16.4	
	347.5(K+0)	10.35	2.01	1,167	1,549	288	16.5	
	345.0(K-1)	9.10	2.09	4,923	6,025	856	17.1	
	342.5(K-2)	7.89	2.01	4,835	3,310	1,276	17.6	
	340.0(K-3)	6.68	1.75	9,549	15,259	587	17.7	

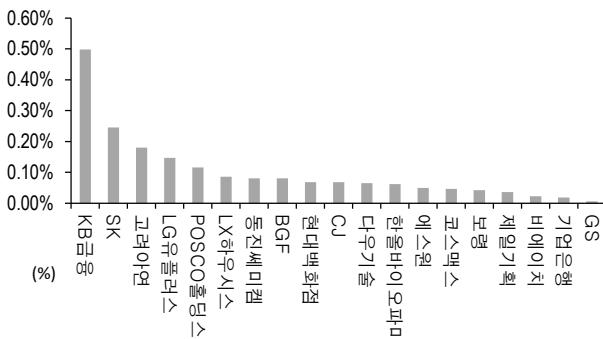
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	2,807,131	2,024.0	3,577,264	233,346	-23,423	82,476	-58,947	-23.3	33.2	-9.8	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
일진머티리얼즈	83,000	-0.36	18.4	91.9	78,609	692	-0.17%	934	-376	-558	280
한국금융지주	69,200	-0.72	8.2	85.8	19,725	2,526	-0.10%	414	166	-580	-1,559
현대차	183,500	0.55	83.5	80.0	41,562	-1,931	-0.08%	-1,639	-263	1,902	4,866
호텔신라	77,400	-0.90	9.4	78.1	11,161	1,206	-0.12%	-150	569	-429	718
삼성전기	151,500	0.00	60.4	65.5	36,059	568	-0.16%	-777	-558	1,331	238
SK 하이닉스	103,500	-1.90	230.1	64.3	193,804	15,503	-0.58%	-8,625	1,119	8,096	19,626
현대위아	64,900	0.15	4.9	63.6	5,028	1,116	-0.12%	731	379	-1,110	-345
한화솔루션	40,650	0.12	26.5	56.2	27,475	2,819	-0.13%	2,849	-898	-1,968	-477
셀트리온헬스케어	60,700	-4.11	18.3	55.1	16,410	7,037	-0.41%	-1,177	1,134	43	10,228
신세계	255,000	-0.78	3.4	54.8	699	65	-0.12%	21	-107	86	76

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터