

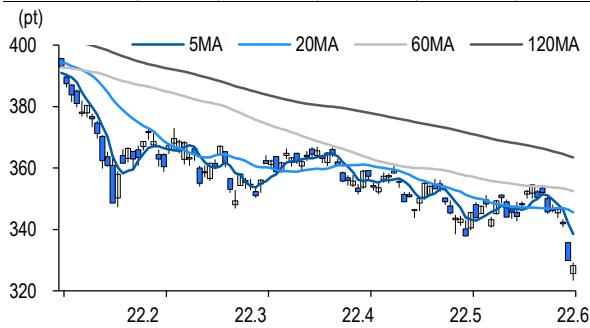


선물옵션시장 지표

2022.6.15

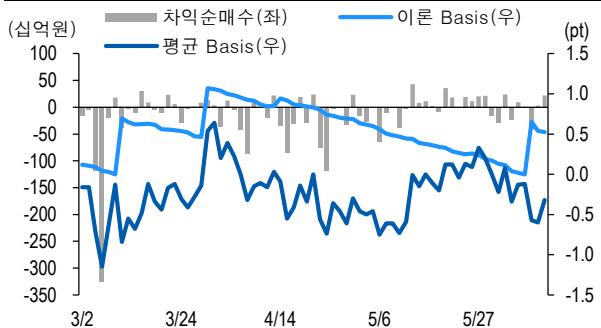
Market Data (십억원, 계약)

| | 종가(pt) | 등락률(%) | 등락폭(pt) | 거래대금 | 미결제 |
|-----------|--------|--------|---------|----------|---------|
| KOSPI200 | 328.23 | -0.50 | -1.65 | 7,328.0 | - |
| 선물 9월물 | 327.00 | -0.68 | -2.25 | 30,642.1 | 288,263 |
| 선물 12월물 | 327.80 | -0.71 | -2.35 | 99.7 | 16,899 |
| 7월물(mini) | 327.00 | -0.70 | -2.32 | 2,424.6 | 65,642 |
| 8월물(mini) | 327.62 | -0.57 | -1.88 | 19.2 | 4,566 |



차익거래 관련 Market data (pt)

| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) |
|----------------|-------|-------|-------|--------|
| K200 베이시스 | 0.52 | -0.32 | -1.23 | -0.26% |
| 베이시스(mini) | -0.45 | -0.59 | -1.23 | -0.04% |
| 제1스프레드(SP) | 0.90 | 0.77 | 0.70 | -0.04% |
| 합성선물 베이시스(ATM) | -0.45 | -1.23 | -1.23 | -0.24% |



투자주체별 매매 동향 (십억원)

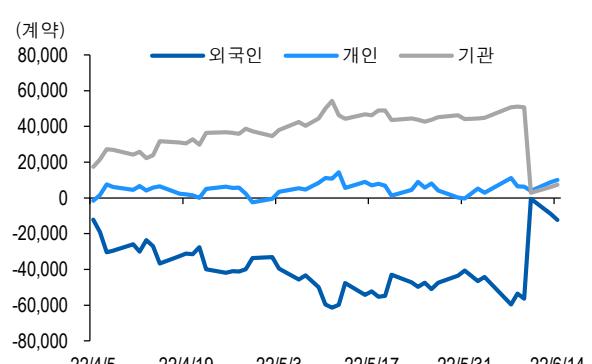
| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 |
|------------|--------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|
| 외국인 | -495.6 | -66.3 | -561.9 | -3.0 | -285.5 | -581.5 | -120.1 | 4.9 | -2.1 | -3.0 |
| 개인 | 667.6 | 204.8 | 872.4 | 0.0 | -10.6 | 306.6 | 92.9 | -7.5 | 8.7 | -47.4 |
| 기관 | -217.5 | -193.1 | -410.6 | 6.0 | 13.3 | 255.2 | 10.6 | 2.6 | -6.7 | 53.6 |
| 금융투자 | -20.0 | -282.8 | -302.7 | -0.4 | 2.8 | 657.2 | 11.5 | 3.5 | -3.9 | 61.1 |
| 투신 | -28.7 | 3.7 | -25.0 | 0.0 | -5.9 | -358.8 | -0.7 | -0.7 | 0.1 | -5.9 |
| 은행+보험+기타금융 | -46.1 | 16.7 | -29.4 | -0.1 | -9.8 | -39.7 | -0.2 | -0.1 | -2.8 | -0.2 |
| 연기금+국가지자체 | -20.8 | 12.7 | -8.0 | 6.5 | 21.8 | -3.5 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -1.3 |
| 기타법인 | 45.6 | 54.6 | 100.1 | 0.0 | -1.7 | 19.7 | 16.7 | 0.0 | 0.1 | -3.3 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



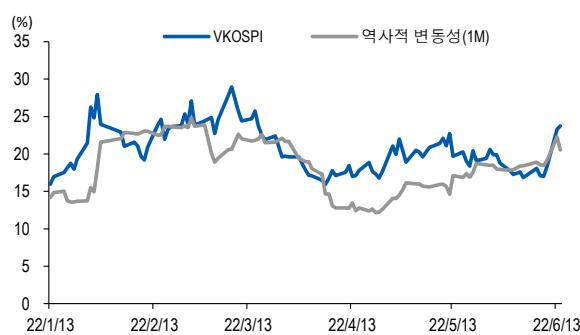
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

| 지수옵션 시장동향 | | | | | | | | | | (계약, 십억원) | |
|-----------|------------|-------|---------|--------|-----------|-------|-----------|--------|------------------|-----------|--------|
| | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | 대표변동성 | | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | | | |
| Call | 993,619 | 367.5 | 660,968 | 19.5% | 지수옵션 전체 | | 2,148,136 | 889.5 | 1,585,719 | | |
| Put | 1,154,517 | 522.0 | 924,751 | 23.2% | PCR(금액기준) | | 1.42 | VKOSPI | 23.74% (+0.44%p) | | |
| Call | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | Put | 행사가 | 종가 | 등락(pt) |
| | 337.5(K+3) | 3.60 | -0.87 | 32,891 | 4,214 | 2,132 | 19.3 | | 332.5(K+1) | 11.10 | 1.21 |
| | 335.0(K+2) | 4.61 | -0.87 | 19,200 | 4,706 | 2,061 | 19.9 | | 330.0(K+0) | 9.76 | 1.09 |
| | 332.5(K+1) | 5.48 | -1.07 | 11,424 | 3,247 | 1,063 | 19.8 | | 327.5(K-1) | 8.49 | 0.91 |
| | 330.0(K+0) | 6.76 | -1.16 | 12,705 | 2,948 | 925 | 20.4 | | 325.0(K-2) | 7.41 | 0.81 |
| | 327.5(K-1) | 7.96 | -1.73 | 5,780 | 1,638 | 1,137 | 20.5 | | 322.5(K-3) | 6.48 | 0.75 |

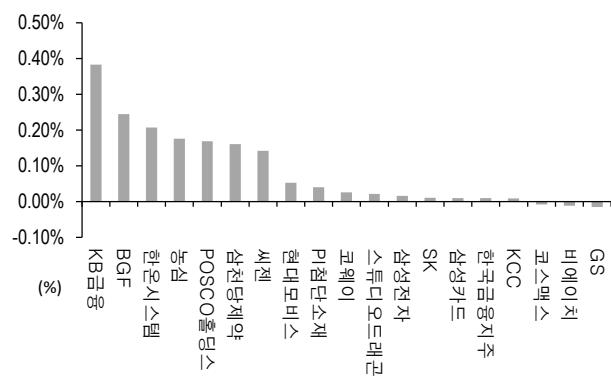
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

| 주식선물 전체 | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | 미결제증감 | 외국인(계약) | 개인(계약) | 기관(계약) | 외국인(금액) | 개인(금액) | 기관(금액) |
|-----------|---------|-----------|--------|--------|---------|---------|--------|---------|--------|--------|
| 4,437,340 | 2,931.6 | 3,680,098 | 68,262 | 55,762 | 39,869 | -99,111 | 35.0 | 34.5 | -71.4 | |

| 종목명 | 선물현재가(원) | 등락률(%) | 선물거래대금(십억원) | 선현배율(%) | 미결제수량(계약) | 미결제증감(계약) | 평균괴리율(%) | 외국인순매수 | 개인순매수 | 기관순매수 | 금융투자순매수 | 연기금등순매수 |
|---------|----------|--------|-------------|---------|-----------|-----------|----------|--------|--------|---------|---------|---------|
| LG 화학 | 564,000 | 0.36 | 106.0 | 77.6 | 8,095 | -245 | -0.10% | 349 | 97 | -446 | -216 | -211 |
| 삼성전기 | 149,500 | 1.36 | 95.1 | 74.0 | 33,674 | -1,933 | -0.16% | -1,027 | 200 | 610 | 2,385 | -1,062 |
| 삼성전자 | 61,800 | 0.00 | 1,065.6 | 73.0 | 1,130,026 | 25,641 | 0.02% | 1,217 | 10,136 | -11,700 | 289 | -22,784 |
| 영진약품 | 4,000 | -1.23 | 1.2 | 71.9 | 4,258 | -1,150 | -0.08% | -530 | 78 | 452 | 452 | 0 |
| 현대차 | 170,500 | -2.57 | 134.5 | 70.6 | 38,614 | 535 | -0.06% | -534 | 2,151 | -1,717 | -196 | -2,510 |
| LG 이노텍 | 375,500 | 0.40 | 45.5 | 68.4 | 9,245 | 149 | -0.12% | -453 | 537 | -84 | 5 | -89 |
| 호텔신라 | 73,700 | -0.67 | 14.4 | 67.7 | 13,016 | 950 | -0.04% | -112 | -717 | 749 | 1,982 | -1,233 |
| GS 건설 | 35,800 | -0.69 | 19.8 | 67.1 | 30,325 | 2,237 | -0.07% | 404 | 2,553 | -2,957 | -2,796 | -161 |
| 일진머티리얼즈 | 78,700 | 0.38 | 26.6 | 66.1 | 74,092 | -1,511 | -0.23% | 1,797 | -3,666 | 1,911 | 2,510 | -595 |
| SK 하이닉스 | 98,900 | -0.10 | 196.4 | 62.4 | 191,168 | -8,100 | -0.25% | 8,360 | 7,094 | -15,798 | -19,280 | 1,385 |

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터