

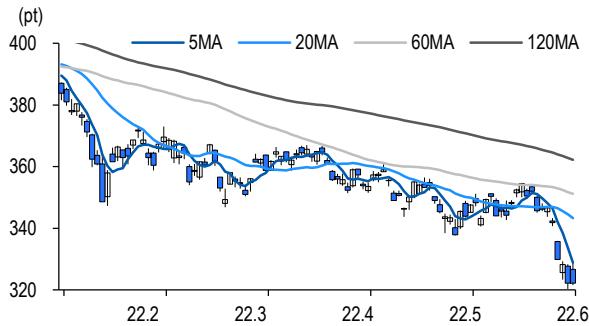


선물옵션시장 지표

2022.6.17

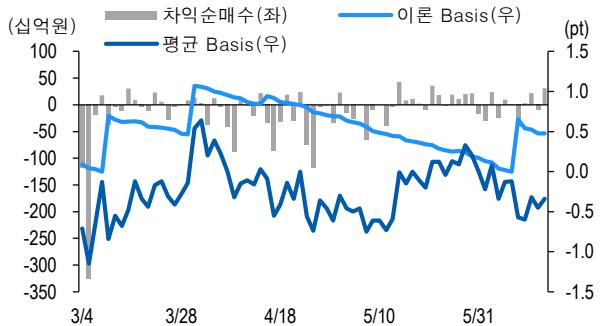
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	322.25	0.01	0.04	6,682.5	-
선물 9월물	321.60	0.06	0.20	31,497.0	297,596
선물 12월물	322.30	0.06	0.20	64.3	17,182
7월물(mini)	321.42	0.04	0.14	2,360.4	72,262
8월물(mini)	321.78	0.16	0.50	22.1	4,716



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.48	-0.34	-0.65	-0.25%
베이시스(mini)	-0.48	-0.63	-0.83	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.87	0.73	0.70	-0.04%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.48	-0.84	-0.84	-0.11%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	156.4	-51.8	104.5	2.0	188.8	653.0	-49.9	11.1	-5.5	15.4
개인	-157.2	-32.6	-189.8	0.0	0.0	-518.5	-17.6	-5.8	3.5	1.4
기관	-18.7	92.2	73.5	29.3	-40.6	-230.9	65.7	-3.5	1.9	-16.6
금융투자	13.5	31.8	45.3	12.9	0.5	-496.6	65.8	-1.0	2.9	-30.1
투신	-8.0	10.6	2.6	0.0	-12.1	257.0	-0.1	-0.9	-0.1	5.3
은행+보험+기타금융	-23.9	20.4	-3.5	0.0	-7.1	25.6	0.0	-1.6	-0.9	0.0
연기금+국가지자체	0.7	13.9	14.5	16.3	-11.4	-17.0	0.0	0.0	0.0	8.2
기타법인	19.5	-7.7	11.7	0.0	-0.1	96.4	1.8	-1.7	0.1	-0.1

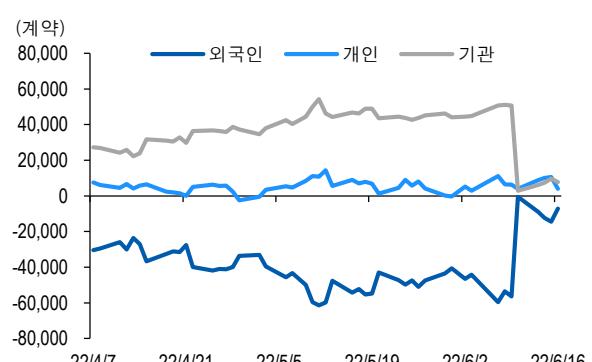
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)									
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정	
Call	984,367	301.2	789,197	20.3%	지수옵션 전체		2,012,158	684.3	1,802,657
Put	1,027,791	383.1	1,013,460	23.2%	PCR(금액기준)		1.27	VKOSPI	23.72%(-0.55%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	330.0(K+3)	3.99	-0.30	14,824	4,350	704	20.2	325.0(K+1)	9.68
	327.5(K+2)	5.00	-0.29	8,190	2,797	610	20.6	322.5(K+0)	8.48
	325.0(K+1)	6.11	-0.32	7,751	2,927	568	20.9	320.0(K-1)	7.36
	322.5(K+0)	7.39	-0.29	4,886	2,149	647	21.4	317.5(K-2)	6.35
	320.0(K-1)	8.71	-0.39	2,711	1,656	341	21.6	315.0(K-3)	5.50
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	325.0(K+1)	9.68	-0.47	10,063	13,019	183	22.0	322.5(K+0)	8.48
	322.5(K+0)	8.48	-0.50	9,364	7,085	528	22.5	320.0(K-1)	7.36
	320.0(K-1)	7.36	-0.46	12,869	15,857	300	22.8	317.5(K-2)	6.35
	317.5(K-2)	6.35	-0.40	12,688	9,121	718	23.2	315.0(K-3)	5.50
	315.0(K-3)	5.50	-0.42	29,007	15,188	1,323	23.7		

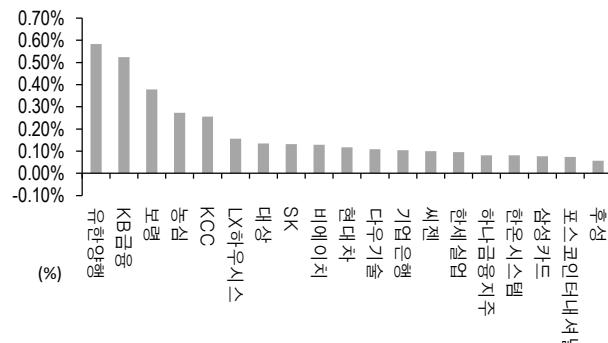
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)
주식선물 전체	4,612,481	3,199.0	3,781,851	49,442	25,648	17,026	-42,470	15.4	1.4	-16.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	60,500	-0.33	1,495.6	107.0	1,145,208	10,286	0.04%	6,966	32,983	-40,159
SK 하이닉스	97,100	-0.61	330.7	87.8	190,195	-5,384	-0.37%	1,462	-7,369	5,707
현대차	172,500	-0.86	78.7	73.4	40,413	600	0.12%	-1,528	567	961
일진머티리얼즈	80,600	10.11	68.8	70.2	68,445	2,044	-0.17%	-1,313	2,672	-1,359
영원무역	42,600	0.47	2.9	69.6	4,783	2,982	-0.63%	1,291	1	-1,292
삼성전기	144,000	-0.69	62.7	65.8	33,688	7	-0.05%	-452	2,388	-1,741
LG 이노텍	371,000	1.78	51.4	64.9	8,543	-579	-0.11%	92	-1,063	971
호텔신라	71,700	-1.38	10.4	63.4	15,037	1,011	-0.07%	-1,118	310	818
기아	77,300	-1.15	53.3	59.4	47,590	1,446	-0.08%	845	-1,234	389
한화솔루션	38,500	-0.77	22.3	58.3	33,162	1,923	-0.11%	2,961	2,334	-5,115

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터