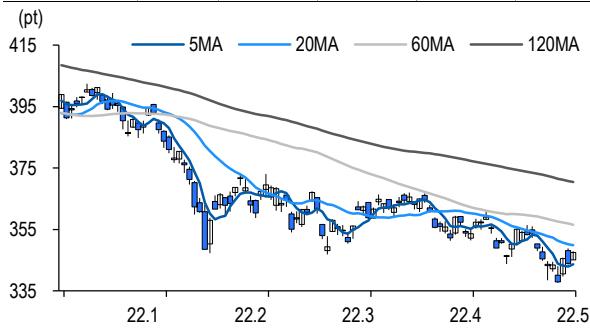


선물옵션시장 지표

2022.5.18

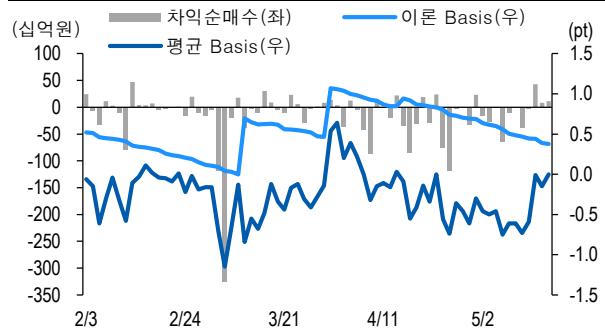
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	347.53	1.04	3.59	5,807.7	-
선물 6월물	347.60	1.00	3.45	16,949.5	292,778
선물 9월물	347.60	1.03	3.55	152.5	13,566
6월물(mini)	347.56	0.99	3.46	1,257.5	55,381
7월물(mini)	347.08	0.90	3.08	7.6	4,426



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.38	0.00	0.07	-0.11%
베이시스(mini)	0.38	0.00	0.03	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.49	-0.05	-0.05	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.38	0.01	0.01	-0.11%



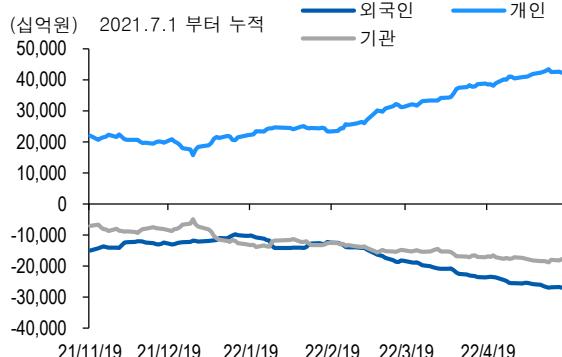
투자주체별 매매 동향

(십억원)

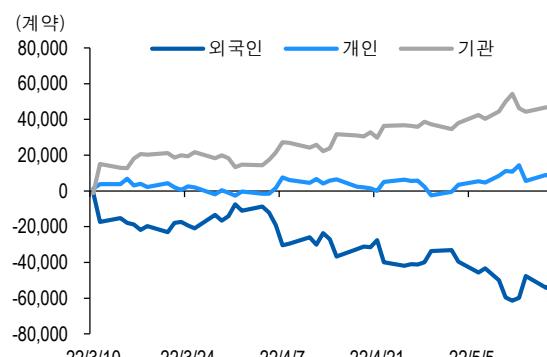
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-159.9	-2.1	-162.0	4.2	-113.3	105.6	58.9	2.4	-1.7	10.8
개인	-304.8	48.7	-256.1	0.0	-5.8	-127.7	-39.5	-2.4	0.5	7.8
기관	461.9	-48.7	413.2	7.3	-24.5	-22.9	-10.9	-0.3	1.3	-23.3
금융투자	459.4	-48.8	410.6	2.2	0.0	-292.3	-11.4	-0.3	1.5	-3.8
투신	-8.8	5.3	-3.5	0.0	-2.7	289.0	0.5	0.0	-0.1	9.6
은행+보험+기타금융	-19.7	-5.4	-25.1	0.0	-3.8	-11.0	0.1	0.0	0.0	0.3
연기금+국가지자체	18.7	0.2	18.9	5.1	-11.7	-8.6	0.0	0.0	0.0	-29.4
기타법인	2.8	2.0	4.8	0.0	-1.3	45.1	-8.5	0.3	-0.2	4.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	513,117	181.0	744,920	15.9%	지수옵션 전체	1,051,635	340.3	1,923,656
Put	538,518	159.3	1,178,736	18.9%	PCR(금액기준)	0.88	VKOSPI	19.06%(-1.21%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	352.5(K+3)	3.72	0.88	22,162	8,190	314	16.0	347.5(K+1)
	350.0(K+2)	4.72	0.89	13,123	14,053	1,153	16.0	345.0(K+0)
	347.5(K+1)	6.05	1.24	7,534	5,010	754	16.4	342.5(K-1)
	345.0(K+0)	7.60	1.54	5,118	11,057	-140	17.0	340.0(K-2)
	342.5(K-1)	9.19	1.73	1,812	2,474	109	17.3	337.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	347.5(K+1)	6.06	-2.19	4,412	5,984	732	17.6	345.0(K+0)
	345.0(K+0)	5.06	-1.88	6,765	10,750	296	18.1	342.5(K-1)
	342.5(K-1)	4.17	-1.70	7,432	3,580	425	18.5	340.0(K-2)
	340.0(K-2)	3.40	-1.53	14,480	20,284	1,416	18.8	337.5(K-3)
	337.5(K-3)	2.79	-1.37	17,096	5,001	967	19.3	

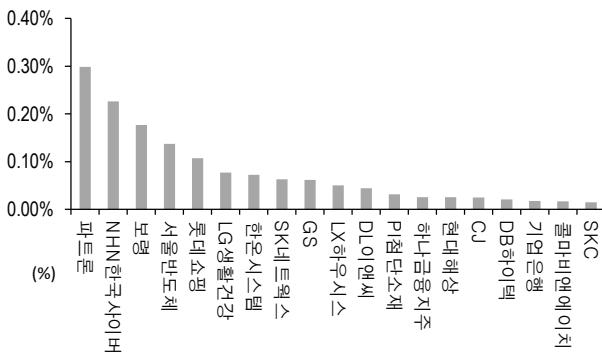
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,005,232	1,996.6	4,470,193	147,286	4,533	1,930	-7,621	10.8	7.8	-23.3
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	67,700	2.11	847.0	80.5	1,285,447	40,573	-0.10%	-319	19,162	-27,109
영진약품	4,530	-1.31	0.8	78.4	9,046	697	-0.15%	-186	-1,321	1,510
현대차	185,500	0.82	67.3	68.9	49,522	-513	-0.09%	-1,567	442	1,125
삼성전기	162,000	2.53	26.9	64.5	30,707	-324	0.00%	1,918	711	-2,625
엔씨소프트	422,000	0.24	24.2	61.6	10,301	362	-0.03%	315	141	-466
일진마티리얼즈	87,000	6.88	24.6	59.9	85,221	1,256	-0.11%	1,142	-436	-695
SK 하이닉스	113,000	2.26	131.7	58.6	207,758	-670	-0.04%	9,317	-9,324	-443
LG 이노텍	343,000	0.88	23.0	55.9	10,352	-101	-0.06%	771	-532	-119
GS 건설	39,450	0.00	9.9	55.6	34,222	-215	-0.03%	930	733	-1,313
LG 화학	505,000	0.00	39.1	48.9	8,663	463	-0.01%	512	-42	-471

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터