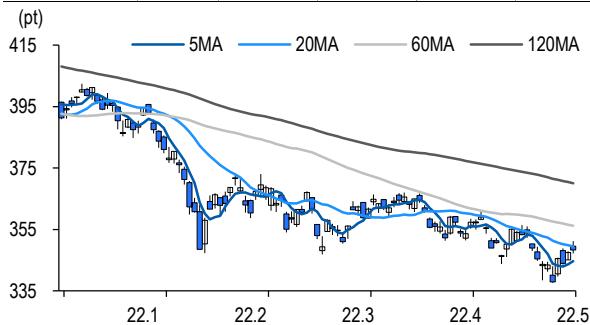


선물옵션시장 지표

2022.5.19

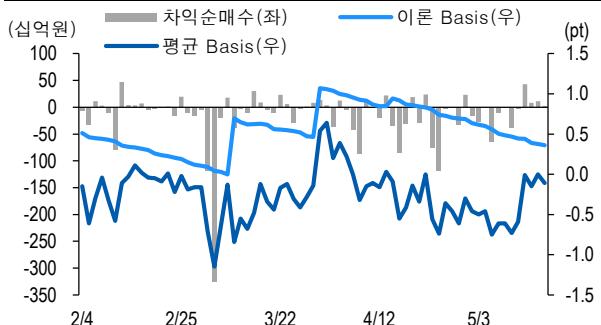
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	348.34	0.23	0.81	5,953.7	-
선물 6월물	348.40	0.23	0.80	20,436.3	292,808
선물 9월물	348.35	0.22	0.75	112.8	13,609
6월물(mini)	348.26	0.19	0.70	1,430.9	57,184
7월물(mini)	347.68	0.17	0.60	5.2	7,485



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.36	-0.11	0.06	-0.14%
베이시스(mini)	0.36	-0.11	-0.08	-0.14%
제1스프레드(SP)	0.49	-0.04	0.00	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.36	-0.17	-0.17	-0.15%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	290.2	67.6	357.8	-0.9	129.7	-236.5	-14.6	-2.6	1.4	-19.5
개인	26.2	-23.9	2.2	0.0	9.5	72.8	15.9	1.6	-2.2	-33.1
기관	-342.8	-45.7	-388.4	3.3	-2.4	235.5	-3.0	1.0	1.0	53.2
금융투자	-313.5	-40.6	-354.0	-0.2	-7.4	428.6	-3.0	1.0	1.0	-0.8
투신	16.5	0.4	16.9	0.0	6.4	-180.3	0.0	0.0	0.0	33.3
은행+보험+기타금융	-6.9	-3.9	-10.8	0.0	-0.9	7.3	-0.1	0.0	0.1	2.0
연기금+국가지자체	-18.9	2.2	-16.8	3.5	7.5	-20.1	0.0	0.0	0.0	18.7
기타법인	26.4	2.0	28.4	0.0	1.5	-71.8	1.8	0.1	-0.2	-0.5

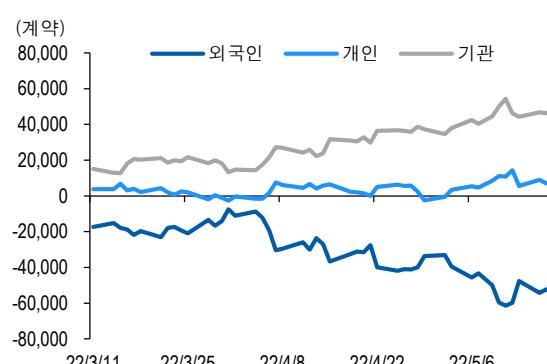
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

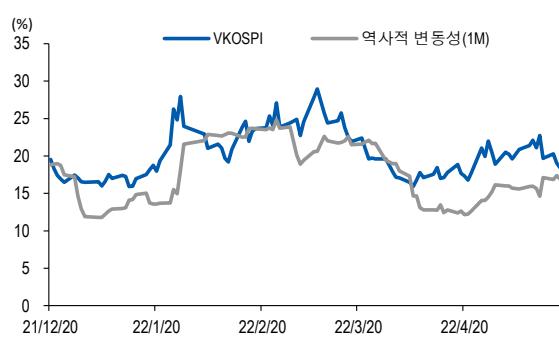




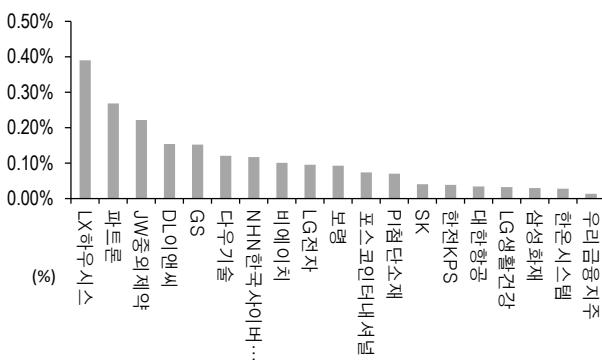
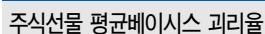
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정						
Call	606,120	193.0	763,041	14.8%	지수옵션 전체		1,348,200	405.8	1,979,152						
Put	742,080	212.8	1,216,111	18.1%	PCR(금액기준)		1.10	VKOSPI	18.40%(-0.66%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내체변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내체변동성
Call	355.0(K+3)	2.67	-0.09	38,072	20,543	36	14.8	Put	350.0(K+1)	6.56	-0.68	5,659	20,568	-193	16.9
	352.5(K+2)	3.70	-0.02	19,266	8,469	279	15.3		347.5(K+0)	5.40	-0.66	9,362	6,531	547	17.2
	350.0(K+1)	4.74	0.02	14,853	15,673	1,620	15.3		345.0(K-1)	4.37	-0.69	13,257	11,845	1,095	17.4
	347.5(K+0)	6.07	0.02	5,312	5,328	318	15.6		342.5(K-2)	3.61	-0.56	20,022	4,161	581	18.0
	345.0(K-1)	7.55	-0.05	3,178	10,602	-455	15.8		340.0(K-3)	2.87	-0.53	39,228	20,409	125	18.3

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)										(계약, 십억원)		
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)		
주식선물 전체	2,987,618	2,192.5	4,538,664	68,471	-38,306	-13,073	52,657	-19.5	-33.1	53.2		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진마티리얼즈	88,700	1.95	25.5	76.0	90,561	5,340	0.01%	-778	8,231	-7,457	-4,916	-2,508
삼성전자	68,000	0.44	830.6	75.6	1,306,440	20,993	-0.09%	-9,144	-25,756	36,170	-2,482	14,250
삼성전기	161,000	-0.62	38.7	67.4	32,342	1,635	-0.01%	-493	2,347	-1,854	-2,094	240
SK 하이닉스	113,500	0.44	266.6	66.0	195,620	-12,138	-0.03%	-2,315	-36,392	38,207	26,173	2,200
삼성 SDI	603,000	2.20	77.6	64.2	21,550	1,008	-0.03%	456	-91	-363	-840	122
현대차	185,500	0.00	63.8	63.9	52,827	3,305	-0.16%	-2,502	3,099	-595	110	-341
현대위아	66,700	1.06	5.8	55.1	7,342	1,126	-0.03%	-215	1,167	-950	-494	-456
LG 화학	514,000	1.78	44.3	50.8	8,115	-548	-0.05%	-980	-2	979	2	867
엔씨소프트	436,000	3.32	29.9	49.8	10,076	-225	-0.07%	-77	-212	299	-210	529
대한항공	29,500	2.08	18.6	47.9	81,515	4,189	0.03%	12,773	-1,941	-10,562	-16,424	-8,378

자료: KBX 유티즌워리 리서치센터