

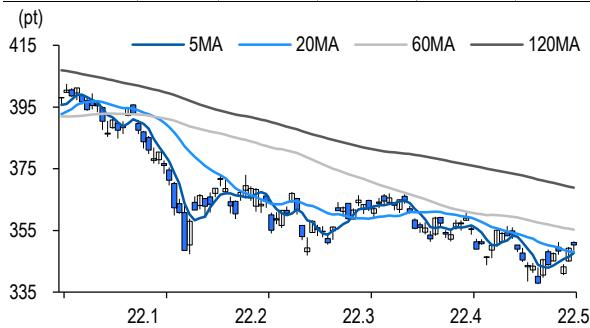


선물옵션시장 지표

2022.5.24

Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	350.34	0.30	1.05	5,391.7	-
선물 6월물	350.70	0.30	1.05	19,246.3	293,553
선물 9월물	350.70	0.33	1.15	130.5	13,492
6월물(mini)	350.66	0.29	0.96	1,482.5	61,148
7월물(mini)	349.80	0.26	0.90	12.8	8,385



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.29	0.12	0.36	-0.05%
베이시스(mini)	0.29	0.12	0.32	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.49	-0.00	0.00	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.29	0.26	0.26	-0.01%



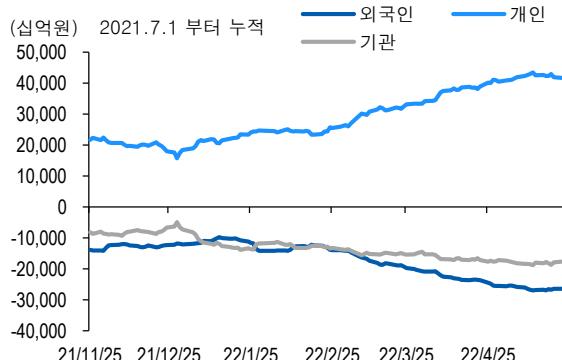
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-29.6	3.2	-26.4	8.1	-35.6	-370.0	-12.8	-4.5	0.2	-19.0
개인	-165.5	25.8	-139.7	0.0	-0.8	264.6	19.3	3.5	-1.4	-1.7
기관	169.4	41.2	210.6	10.1	-17.4	80.4	-6.8	0.6	0.7	20.5
금융투자	344.4	62.1	406.5	9.2	1.9	336.2	-7.5	0.6	-0.1	27.3
투신	-39.3	-4.7	-44.0	0.0	2.7	-264.5	0.7	0.0	0.0	3.4
은행+보험+기타금융	0.9	-10.9	-10.1	0.0	0.1	-7.2	0.0	0.0	0.8	-0.2
연기금+국가지자체	-58.5	-4.9	-63.4	0.9	-26.1	15.9	0.0	0.0	0.0	-9.9
기타법인	25.7	-70.1	-44.4	0.0	0.1	25.0	0.3	0.4	0.4	0.3

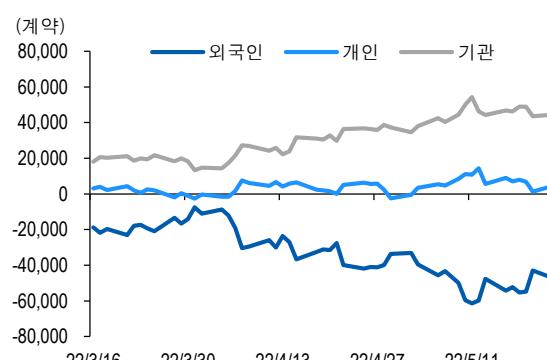
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	579,585	190.1	823,416	16.3%	지수옵션 전체	1,265,507	392.6	2,139,817							
Put	685,922	202.5	1,316,401	19.0%	PCR(금액기준)	1.07	VKOSPI	19.44% (+0.34%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	357.5(K+3)	2.40	0.11	55,043	14,489	-840	16.3	Put	352.5(K+1)	6.36	-0.79	2,573	1,864	426	17.3
	355.0(K+2)	3.36	0.16	34,684	22,888	-426	16.8		350.0(K+0)	5.17	-0.72	7,942	15,998	518	17.7
	352.5(K+1)	4.45	0.26	13,943	10,167	560	17.1		347.5(K-1)	4.17	-0.62	9,504	6,215	134	18.1
	350.0(K+0)	5.77	0.33	11,937	17,377	-105	17.6		345.0(K-2)	3.40	-0.52	18,644	13,690	758	18.8
	347.5(K-1)	7.29	0.38	3,943	6,469	121	18.1		342.5(K-3)	2.69	-0.50	25,791	6,721	100	19.2

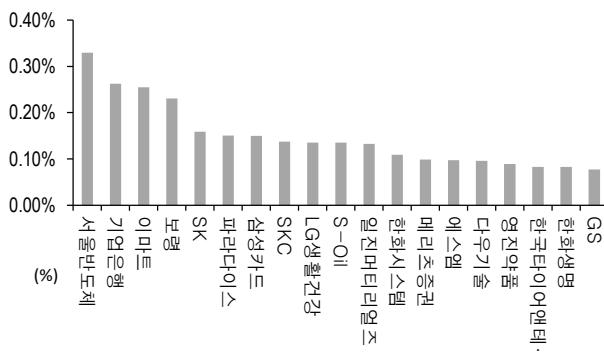
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,990,576	2,158.7	4,588,600	-4,421	-23,014	-15,418	35,595	-19.0	-1.7	20.5
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
일진마티리얼즈	95,100	0.00	25.5	101.1	119,000	2,958	0.13%	1,204	2,327	-3,536
삼성전자	68,000	-0.15	733.9	79.1	1,255,783	-11,911	-0.10%	-14,492	3,467	10,707
BGF	5,150	2.59	0.4	78.4	5,761	-1,365	-0.35%	43	2,070	-3,676
현대차	188,000	0.80	62.0	76.1	53,685	2,626	-0.05%	-1,221	1,015	-594
엔씨소프트	455,500	1.22	33.2	71.2	9,870	-302	0.04%	-431	-142	573
SK 하이닉스	113,000	0.44	234.1	66.3	191,898	-3,419	-0.23%	977	89	-586
LG 디스플레이	17,500	2.64	19.0	66.2	103,904	1,149	-0.01%	-6,649	-7,173	13,822
삼성 SDI	612,000	1.16	80.0	61.4	21,848	-119	-0.07%	-31	-138	174
KB 금융	58,200	0.34	31.2	58.1	41,335	-3,605	-0.01%	-2,009	-2,566	4,625
신한지주	41,650	-0.24	21.6	57.0	83,472	-2,669	0.02%	-6	1,649	-1,643

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터