

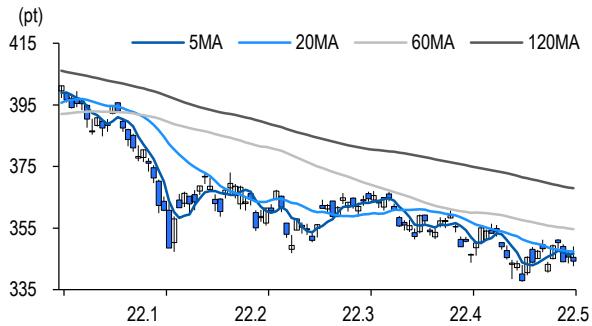


선물옵션시장 지표

2022.5.27

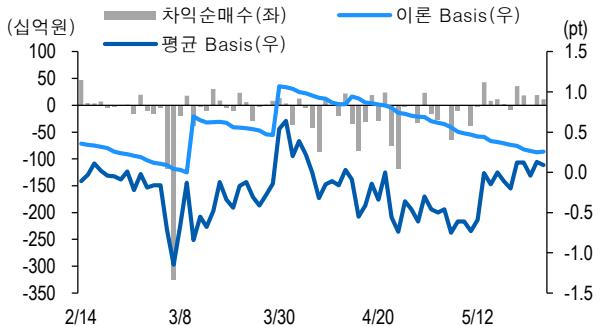
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	344.26	-0.39	-1.34	6,152.8	-
선물 6월물	344.80	-0.39	-1.35	23,499.0	297,562
선물 9월물	344.80	-0.33	-1.15	192.9	15,524
6월물(mini)	344.80	-0.39	-1.34	2,110.9	61,539
7월물(mini)	343.98	-0.43	-1.48	20.3	9,211



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.26	0.09	0.54	-0.05%
베이시스(mini)	0.26	0.09	0.54	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.49	0.09	0.10	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	0.26	0.49	0.49	0.07%



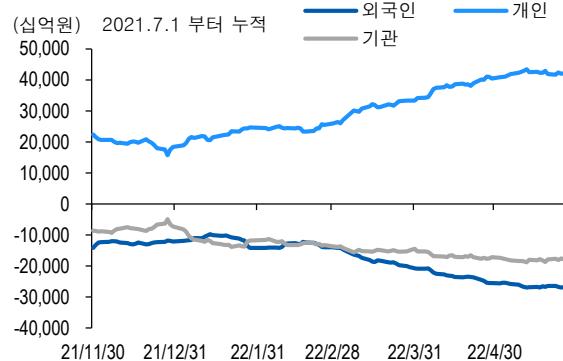
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	36.4	17.4	53.8	2.3	219.6	-361.6	54.9	1.7	-1.1	17.8
개인	93.4	23.8	117.1	0.0	-1.7	150.8	47.4	-1.7	1.3	-26.1
기관	-154.8	-45.4	-200.2	9.0	1.9	200.6	-107.7	0.5	0.0	8.6
금융투자	-33.3	-55.8	-89.2	10.8	11.3	354.7	-109.4	0.6	0.4	49.8
투신	-31.2	7.3	-23.9	0.0	-2.9	-166.8	1.4	-0.1	0.0	-54.4
은행+보험+기타금융	-28.5	6.2	-22.2	0.0	2.1	9.2	0.4	0.0	-0.5	0.1
연기금+국가지자체	-79.7	1.6	-78.1	-1.8	-7.9	3.4	0.0	0.0	0.0	13.0
기타법인	25.0	4.2	29.2	0.0	0.2	10.2	5.4	-0.5	-0.2	-0.3

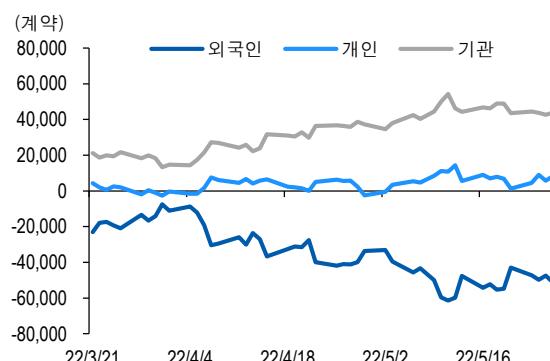
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,014,180	259.9	893,694	15.9%	지수옵션 전체	1,973,027	527.6	2,304,828							
Put	958,847	267.7	1,411,134	18.3%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	19.91% (+0.02%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	352.5(K+3)	1.59	-0.59	85,020	14,321	2,669	16.0	Put	347.5(K+1)	6.20	0.52	9,337	6,581	513	16.3
	350.0(K+2)	2.36	-0.81	59,913	20,535	2,674	16.4		345.0(K+0)	4.95	0.33	23,304	14,681	889	16.9
	347.5(K+1)	3.40	-0.84	23,218	8,286	404	17.0		342.5(K-1)	3.91	0.23	28,837	8,695	675	17.5
	345.0(K+0)	4.70	-0.97	13,531	14,666	1,397	17.7		340.0(K-2)	3.07	0.19	47,159	22,170	-1,156	18.1
	342.5(K-1)	6.15	-1.10	3,217	4,464	363	18.3		337.5(K-3)	2.42	0.16	55,545	12,827	630	18.8

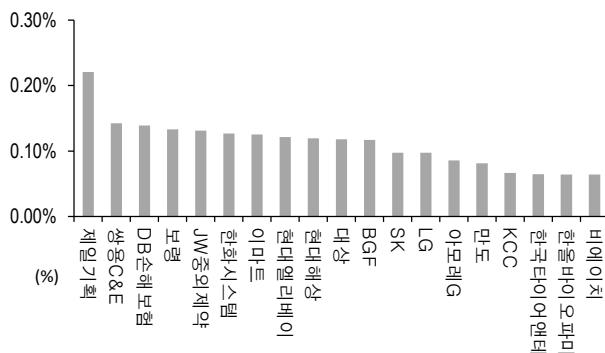
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,440,948	2,541.7	4,535,850	20,782	27,508	-51,754	24,963	17.8	-26.1	8.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	184,500	0.54	71.7	90.8	48,286	-991	-0.04%	-217	-1,372	1,588
삼성전자	65,900	-0.75	784.1	74.3	1,204,510	24,414	-0.05%	10,285	-14,662	4,650
SK 네트웍스	4,610	-0.22	0.8	70.3	13,497	978	-0.07%	4,006	-1,077	-2,929
현대건설	42,000	-0.59	10.2	65.3	16,911	2,657	-0.01%	2,306	-207	-2,099
SK 하이닉스	102,500	-5.09	543.7	61.1	196,141	3,501	-0.13%	8,723	-2,755	-5,657
LG 이노텍	374,000	-1.71	58.2	58.8	10,817	-49	0.00%	-533	555	-22
신한지주	42,300	0.00	21.6	56.7	73,153	-3,134	-0.05%	-261	-1,861	2,083
엔씨소프트	456,000	2.36	37.7	55.5	10,196	-121	0.02%	-47	-136	160
LG 전자	102,000	0.00	37.2	54.1	48,481	1,009	-0.12%	978	-1,329	363
KB 금융	59,100	-0.67	27.0	53.9	42,901	1,216	-0.01%	1,827	-877	-950

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터