

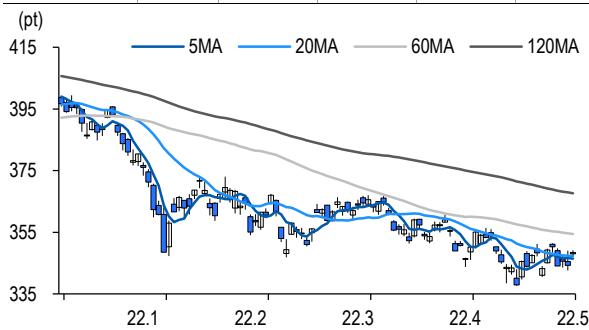


선물옵션시장 지표

2022.5.30

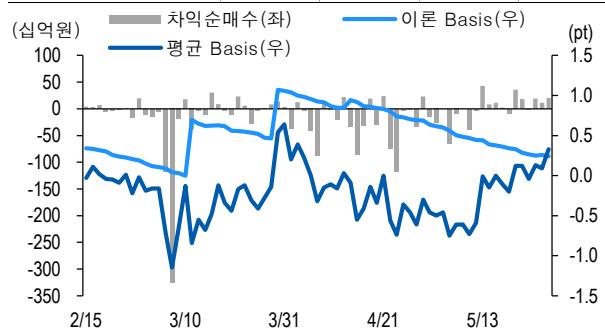
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	348.04	1.10	3.78	5,318.0	-
선물 6월물	348.90	1.19	4.10	19,240.3	295,710
선물 9월물	349.10	1.25	4.30	200.6	17,139
6월물(mini)	348.80	1.16	4.00	1,554.5	61,796
7월물(mini)	348.02	1.17	4.04	18.1	9,741



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.24	0.33	0.86	0.03%
베이시스(mini)	0.24	0.33	0.76	0.03%
제1스프레드(SP)	0.70	0.11	0.15	-0.17%
합성선물 베이시스(ATM)	0.24	0.72	0.72	0.14%



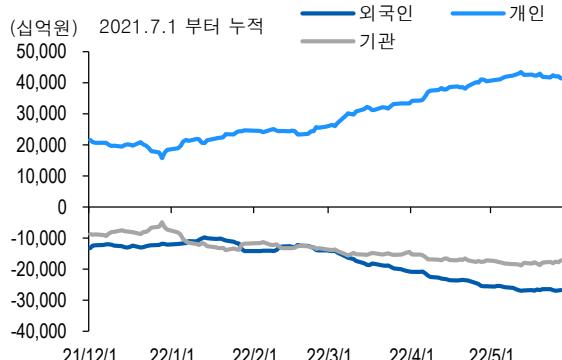
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	188.4	-9.7	178.7	4.4	82.8	203.2	106.0	2.7	-5.1	-13.5
개인	-744.3	-34.4	-778.7	0.0	0.3	-271.3	-62.1	-0.9	1.3	-40.6
기관	554.9	44.2	599.0	16.1	33.9	152.7	-38.0	-2.1	3.7	52.9
금융투자	498.6	70.6	569.2	4.2	16.9	-394.4	-38.3	-1.1	1.2	69.0
투신	15.8	-8.1	7.7	0.0	-3.5	435.3	0.7	0.0	0.0	9.2
은행+보험+기타금융	-4.5	-9.0	-13.5	0.0	4.1	121.5	-0.3	-0.9	2.6	0.1
연기금+국가지자체	27.7	-2.6	25.1	5.0	13.6	-9.6	0.0	0.0	0.0	-25.4
기타법인	1.0	-0.1	0.9	0.0	-0.2	-84.5	-5.9	0.2	0.1	1.2

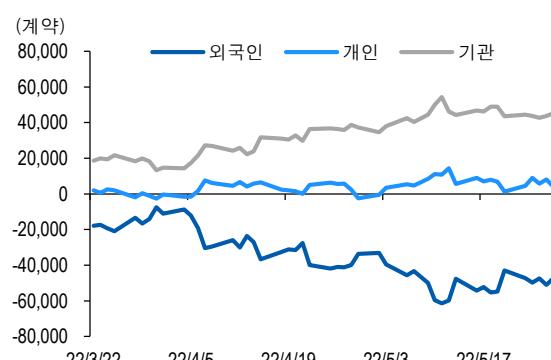
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	719,757	220.0	904,622	15.5%	지수옵션 전체	1,572,116	396.9	2,374,455
Put	852,359	176.9	1,469,833	17.2%	PCR(금액기준)	0.80	VKOSPI	18.80%(-1.11%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	352.5(K+3)	2.48	0.89	67,376	14,671	350	15.5	347.5(K+1)
	350.0(K+2)	3.63	1.27	43,689	21,267	732	16.2	345.0(K+0)
	347.5(K+1)	5.01	1.61	10,338	9,037	751	16.9	342.5(K-1)
	345.0(K+0)	6.63	1.93	6,885	14,996	330	17.7	340.0(K-2)
	342.5(K-1)	8.44	2.29	2,869	4,467	3	18.6	337.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	347.5(K+1)	3.75	-2.45	12,338	7,793	1,212	15.2	345.0(K+0)
	345.0(K+0)	2.87	-2.08	28,823	17,759	3,078	16.0	342.5(K-1)
	342.5(K-1)	2.14	-1.77	41,022	11,272	2,577	16.5	340.0(K-2)
	340.0(K-2)	1.62	-1.45	54,833	25,776	3,606	17.2	337.5(K-3)
	337.5(K-3)	1.23	-1.19	47,807	13,999	1,172	18.0	

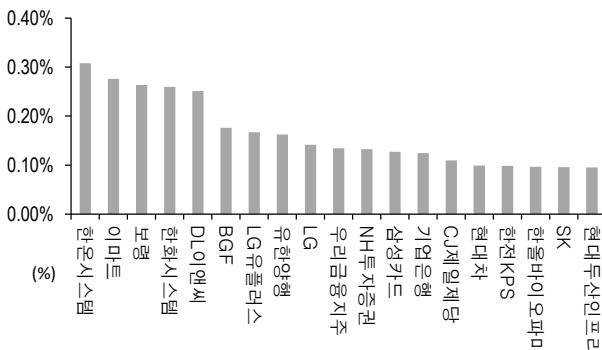
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,026,436	2,107.3	4,447,952	-87,898	7,856	-64,261	54,021	-13.5	-40.6	52.9
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
영원무역	46,450	1.86	10.6	90.9	5,162	-5,389	0.01%	-122	-188	310
삼성전자	66,600	1.06	662.2	87.5	1,171,536	-32,974	0.01%	-10,735	9,135	1,370
GS건설	39,550	0.00	7.5	79.7	33,822	4,410	0.03%	-2,353	4,780	-3,327
현대건설	42,150	0.36	9.2	71.2	18,302	1,391	0.00%	-3,549	4,852	-1,303
현대차	185,500	0.54	42.5	68.5	46,920	-1,366	0.10%	-750	-1,457	2,207
SK하이닉스	105,500	2.93	265.1	68.1	176,308	-19,833	-0.23%	-82	-25,445	25,232
삼성SDI	591,000	1.55	50.4	65.2	20,334	-353	0.00%	-384	506	-180
엔씨소프트	451,500	-0.99	16.3	56.3	9,735	-461	-0.02%	61	-563	502
현대제철	41,150	0.49	5.1	54.1	13,636	-118	0.02%	647	-769	122
일진미티리얼즈	78,900	-3.07	41.5	53.5	75,031	-15,804	-0.24%	962	-16,871	15,957
										113

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터