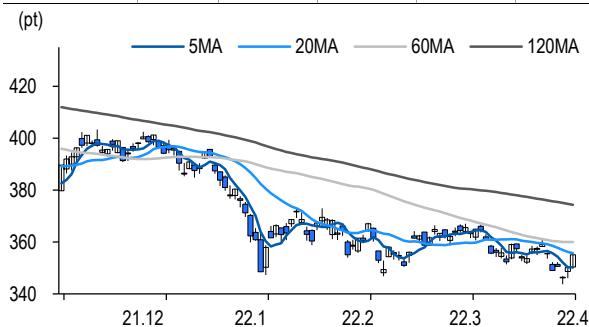


## 선물옵션시장 지표

2022.5.2

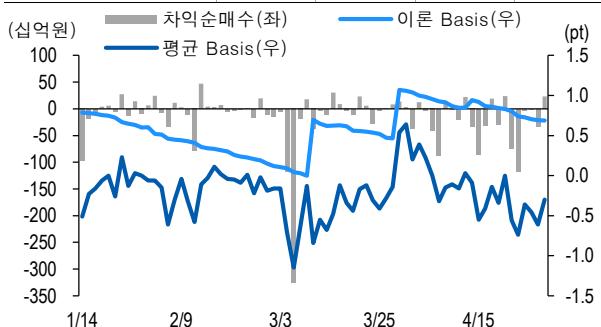
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	355.08	1.41	4.92	7,934.0	-
선물 6월물	355.60	1.63	5.70	20,720.1	274,080
선물 9월물	355.45	1.69	5.90	55.3	12,692
5월물(mini)	355.50	1.61	5.62	1,515.2	53,098
6월물(mini)	355.34	1.55	5.44	30.3	4,214



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.69	-0.30	0.52	-0.28%
베이시스(mini)	0.22	-0.31	0.42	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.52	0.04	0.05	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.22	0.29	0.29	0.02%



## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	13.7	2.3	16.0	11.8	49.2	656.2	-112.3	2.7	0.3	-15.6
개인	-486.6	-1.7	-488.3	0.0	4.5	-387.6	-36.3	1.7	-2.6	46.2
기관	490.9	-2.4	488.5	11.2	27.2	-266.7	150.9	-5.0	3.4	-30.1
금융투자	203.8	-17.6	186.2	-10.1	-0.1	-450.1	148.1	-4.9	3.1	-25.7
투신	79.6	5.0	84.5	0.0	19.9	206.1	3.0	-0.1	0.2	-4.8
은행+보험+기타금융	-7.5	9.3	1.8	0.0	-6.7	8.2	-0.1	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	116.6	3.0	119.6	21.3	10.0	-30.9	0.0	0.0	0.0	0.3
기타법인	-18.0	1.8	-16.2	0.0	0.3	-1.9	-2.3	0.7	-1.0	-0.4

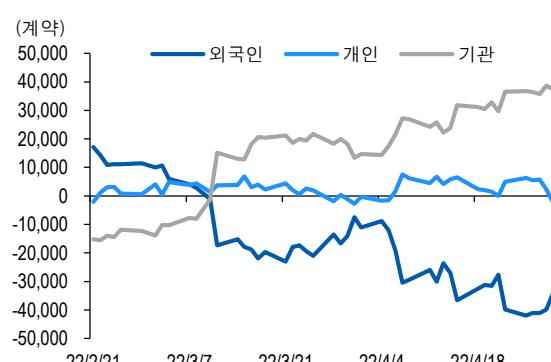
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	1,133,559	334.2	865,165	15.6%	지수옵션 전체	2,114,953	573.0	2,184,282
Put	981,394	238.7	1,319,117	18.9%	PCR(금액기준)	0.71	VKOSPI	18.92%(-1.53%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	357.5(K+3)	3.42	1.70	81,251	19,146	-242	15.9	352.5(K+1)
	355.0(K+2)	4.70	2.12	56,567	17,528	-2,117	16.4	350.0(K+0)
	352.5(K+1)	6.17	2.47	16,805	9,288	-43	16.8	347.5(K-1)
	350.0(K+0)	7.97	2.97	9,661	9,384	14	17.7	345.0(K-2)
	347.5(K-1)	9.88	3.41	4,046	3,692	72	18.4	342.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	352.5(K+1)	3.34	-3.00	11,570	7,225	1,177	16.7	350.0(K+0)
	350.0(K+0)	2.60	-2.59	36,204	13,566	1,879	17.4	347.5(K-1)
	347.5(K-1)	2.00	-2.17	28,000	8,856	1,487	18.1	345.0(K-2)
	345.0(K-2)	1.54	-1.81	49,564	18,082	2,328	18.8	342.5(K-3)
	342.5(K-3)	1.18	-1.48	48,332	10,314	585	19.4	

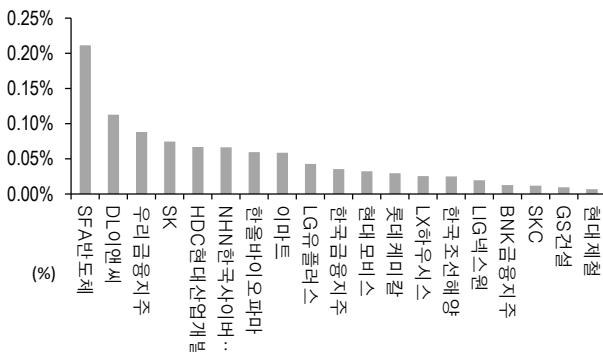
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	3,865,137	2,867.1	4,803,493	-6,465	-10,562	31,999	-21,972	-15.6	46.2	-30.1
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	187,000	-1.06	121.7	85.7	58,754	1,188	0.01%	65	-505	457
삼성전자	67,400	3.53	1,232.2	70.7	1,247,588	-14,460	-0.06%	12,366	44,527	-54,142
메리츠증권	6,530	-1.36	5.5	66.0	61,788	8,517	-0.21%	5,366	-9,817	-74
일진머티리얼즈	88,300	1.49	10.6	60.8	106,938	478	0.00%	-9	2,174	-2,190
호텔신라	81,300	0.00	7.5	56.4	25,660	195	-0.04%	351	311	-662
GS 건설	42,150	-1.17	9.9	56.4	42,406	311	0.01%	-666	3,355	-3,159
삼성전기	166,000	2.15	60.3	54.6	28,880	-2,052	-0.06%	2,197	175	-2,372
SK 하이닉스	112,500	2.27	224.1	53.7	186,222	5,953	0.00%	948	5,109	-6,303
삼성 SDI	612,000	2.51	123.0	49.7	22,730	-1,982	-0.15%	-184	1,544	-1,356
하나금융지주	47,100	-0.84	16.9	47.4	94,719	-239	0.01%	-1,751	1,930	-179

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터