

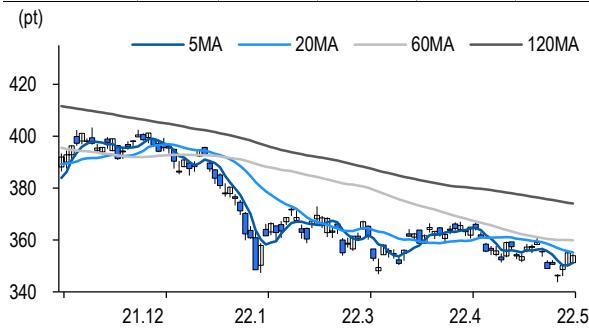


선물옵션시장 지표

2022.5.3

Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	354.02	-0.30	-1.06	5,167.1	-
선물 6월물	353.45	-0.60	-2.15	18,882.4	273,444
선물 9월물	353.40	-0.58	-2.05	40.9	12,761
5월물(mini)	353.52	-0.56	-1.98	1,360.9	50,983
6월물(mini)	353.50	-0.59	-1.84	15.2	4,320



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.63	-0.46	-0.57	-0.31%
베이시스(mini)	0.17	-0.39	-0.50	-0.16%
제1스프레드(SP)	0.51	0.02	0.05	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.17	-0.53	-0.53	-0.20%



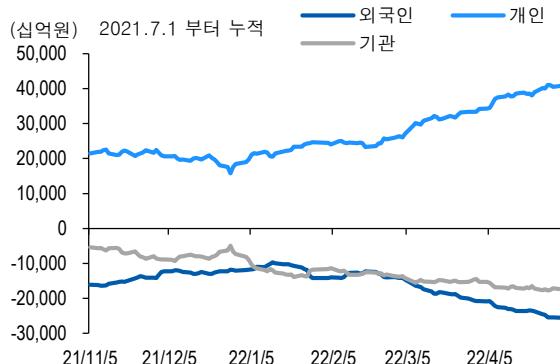
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-68.5	-27.6	-96.1	1.1	-15.1	5.5	50.8	-0.8	1.4	17.0
개인	224.9	101.2	326.1	0.0	-3.5	172.7	-2.1	1.8	-3.1	18.6
기관	-180.8	-73.1	-253.9	-15.9	30.3	-198.4	-47.6	-1.1	2.0	-36.0
금융투자	-96.0	-91.9	-187.9	-1.8	5.1	234.1	-47.3	-1.1	2.1	-16.7
투신	35.8	8.2	44.0	0.0	38.4	-472.5	-0.1	0.0	-0.1	-33.8
은행+보험+기타금융	-21.2	8.2	-13.1	0.0	-16.2	26.0	-0.2	0.0	0.0	0.3
연기금+국가지자체	-5.2	-3.0	-8.2	-14.1	8.1	14.1	0.0	0.0	0.0	14.3
기타법인	24.3	-0.5	23.9	0.0	-0.6	20.3	-1.2	0.2	-0.3	0.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



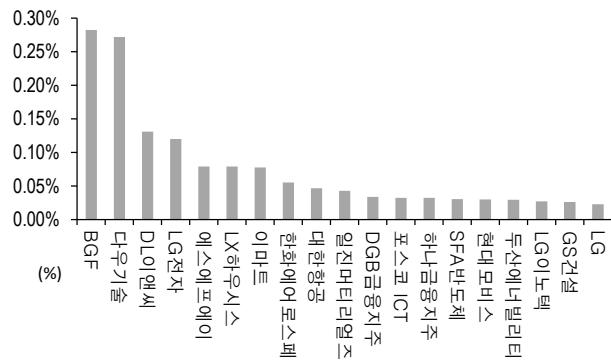
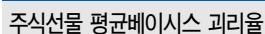
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	614,621	179.2	879,768	16.0%	지수옵션 전체	1,426,127	399.9	2,277,117							
Put	811,506	220.6	1,397,349	21.5%	PCR(금액기준)	1.23	VKOSPI	20.50%(+1.58%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	362.5(K+3)	1.09	-0.31	85,477	24,030	-2,487	15.8	Put	357.5(K+1)	6.64	1.17	1,829	4,877	174	19.5
	360.0(K+2)	1.71	-0.51	96,948	22,799	-1,373	16.0		355.0(K+0)	5.33	1.01	5,948	9,711	-87	20.1
	357.5(K+1)	2.63	-0.79	52,679	19,694	548	16.5		352.5(K-1)	4.22	0.88	11,193	8,102	877	20.5
	355.0(K+0)	3.82	-0.88	38,938	17,456	-72	17.1		350.0(K-2)	3.32	0.72	22,764	12,912	-654	21.1
	352.5(K-1)	5.20	-0.97	9,970	9,680	392	17.6		347.5(K-3)	2.56	0.56	28,461	9,427	571	21.6

자료: KRX, 유안티증권 리서치센터



자료: KRX, 유안티증권 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	2,835,862	2,043.3	4,813,046	9,553	33,984	25,288	-60,350	17.0	18.6	-36.0		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균과리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	67,200	-0.30	785.1	83.2	1,235,368	-12,220	-0.09%	-10,296	-1	9,636	-6,146	19,300
SK 하이닉스	110,500	-1.78	196.2	82.4	188,271	2,049	-0.04%	-2,499	7,082	-4,805	-3,132	1,300
현대차	187,500	0.27	72.7	78.9	60,855	2,101	0.01%	1,613	1,997	-3,610	-2,142	-1,437
일진머티리얼즈	89,100	0.91	8.6	76.7	106,986	48	0.04%	1,172	485	-1,667	-674	-993
한국조선해양	91,500	-0.33	6.9	71.2	7,475	-706	0.00%	276	266	-542	-788	246
삼성전기	168,500	1.51	49.1	58.6	30,934	2,054	-0.15%	-1,387	2,709	-1,322	-1,088	-210
LG 이노텍	346,500	-0.86	50.8	56.5	11,843	8	0.03%	274	603	-818	-333	-111
메리츠증권	6,800	4.13	6.2	55.4	61,915	127	-0.09%	2,555	20,636	-22,776	-22,676	-100
GS 건설	42,350	0.47	12.2	53.5	43,144	738	0.03%	2,114	-631	-1,472	-390	-1,082
LG 생활건강	908,000	0.00	15.6	49.8	6,643	233	-0.42%	185	-271	86	131	1

자료: KBX 유티즌워리 리서치센터