

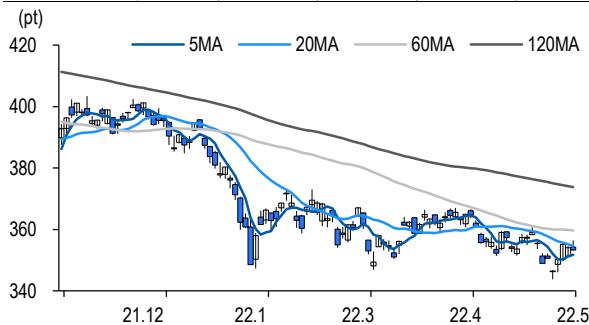


선물옵션시장 지표

2022.5.4

Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	353.32	-0.20	-0.70	5,354.1	-
선물 6월물	352.85	-0.17	-0.60	21,544.2	275,009
선물 9월물	352.60	-0.23	-0.80	66.3	12,827
5월물(mini)	352.86	-0.19	-0.66	1,514.2	52,615
6월물(mini)	352.98	-0.14	-0.52	25.9	4,588



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.62	-0.50	-0.47	-0.32%
베이시스(mini)	0.15	-0.39	-0.46	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.51	0.05	-0.05	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.15	-0.48	-0.48	-0.18%



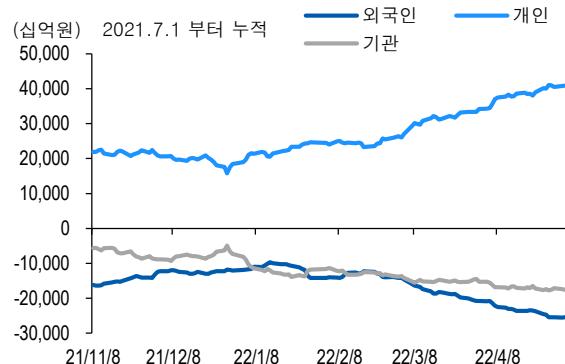
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	118.9	35.6	154.5	-2.5	96.3	-585.3	13.4	-0.9	0.2	-14.7
개인	103.8	-8.9	95.0	0.0	-0.1	336.7	17.4	2.7	-3.0	7.0
기관	-213.5	-29.0	-242.5	-23.6	-7.8	327.8	-27.2	-2.2	3.3	8.6
금융투자	-175.6	-51.3	-226.8	-7.8	-4.6	334.6	-27.1	-2.2	3.4	-9.9
투신	15.9	2.1	18.0	0.0	12.7	-38.5	-0.1	0.0	0.0	30.6
은행+보험+기타금융	-16.6	16.3	-0.3	0.0	-13.7	16.5	0.0	0.0	-0.1	0.3
연기금+국가지자체	-45.9	-0.2	-46.1	-14.0	-8.5	15.2	0.0	0.0	0.0	-12.5
기타법인	-9.2	2.2	-7.0	0.0	-0.1	-79.2	-3.7	0.3	-0.4	-0.8

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	916,883	246.2	909,764	15.4%	지수옵션 전체		1,843,286	464.6	2,340,991
Put	926,403	218.4	1,431,227	20.8%	PCR(금액기준)		0.89	VKOSPI	20.25%(-0.25%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	362.5(K+3)	0.74	-0.35	125,812	25,461	1,431	15.1	357.5(K+1)	6.85
	360.0(K+2)	1.33	-0.38	118,047	23,675	876	15.8	355.0(K+0)	5.36
	357.5(K+1)	2.12	-0.51	77,544	20,815	1,121	16.2	352.5(K-1)	4.16
	355.0(K+0)	3.20	-0.62	32,544	17,711	255	16.7	350.0(K-2)	3.26
	352.5(K-1)	4.50	-0.70	7,120	10,118	438	17.1	347.5(K-3)	2.45

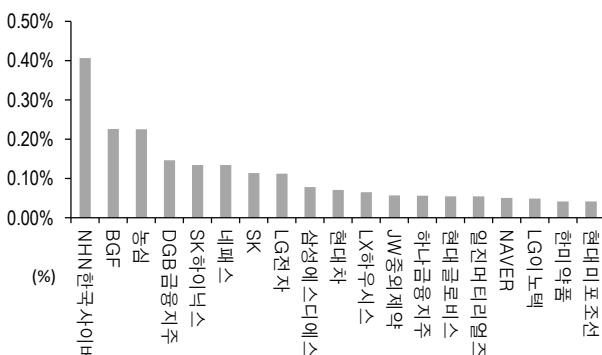
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 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	3,011,636	2,220.0	4,831,928	18,882	-25,241	-13,333	39,705	-14.7	7.0	8.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	67,400	0.30	866.1	90.1	1,236,587	1,219	-0.09%	-2,340	-6,078	9,454
SK 하이닉스	109,500	-0.90	246.7	83.8	188,684	413	0.13%	-4,960	1,048	3,888
현대차	183,500	-2.13	97.0	80.0	61,682	827	0.07%	-1,247	1,003	234
일진마티리얼즈	88,300	-0.90	9.7	68.5	103,634	-3,352	0.05%	397	972	-1,369
GS 건설	41,900	-1.06	10.1	58.4	36,655	-6,489	0.01%	1,045	-3,092	2,070
신한지주	41,650	0.00	15.8	56.4	67,206	-1,198	-0.07%	1,605	-1,568	-37
한국조선해양	90,500	-1.09	5.9	52.7	7,339	-136	0.03%	81	387	-468
카카오	88,400	1.26	63.0	49.9	95,625	1,112	-0.05%	5,151	-267	-4,879
LG 화학	519,000	-1.52	41.7	49.7	8,775	38	0.02%	217	219	-442
현대모비스	207,000	-0.72	16.2	48.8	9,960	-85	0.03%	-161	-5	157

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터