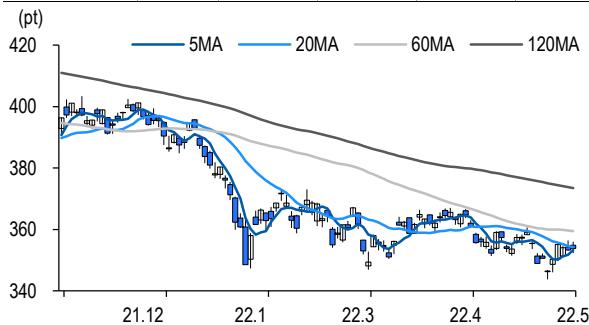


## 선물옵션시장 지표

2022.5.6

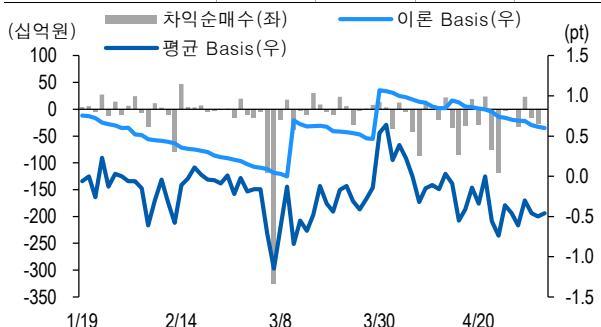
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	353.85	0.15	0.53	5,532.8	-
선물 6월물	353.55	0.20	0.70	16,894.5	276,265
선물 9월물	353.80	0.34	1.20	53.7	12,820
5월물(mini)	353.74	0.25	0.88	1,670.6	54,695
6월물(mini)	353.40	0.15	0.42	41.5	4,922



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.60	-0.46	-0.30	-0.30%
베이시스(mini)	0.13	-0.32	-0.11	-0.13%
제1스프레드(SP)	0.51	-0.00	0.00	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.13	-0.25	-0.25	-0.11%



## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

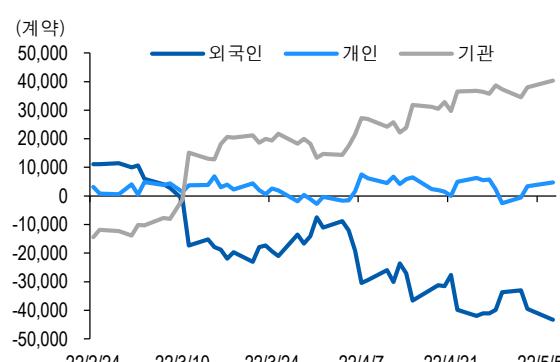
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	31.4	3.6	35.0	-3.9	61.5	-341.8	1.0	-3.5	0.7	-4.3
개인	100.9	2.7	103.6	0.0	-4.4	118.2	-7.2	1.4	0.9	-4.7
기관	-150.2	-6.5	-156.7	4.5	-46.9	200.3	8.5	2.1	-1.3	9.7
금융투자	64.4	121.2	185.7	-4.4	1.8	284.0	8.5	2.2	-1.2	-29.0
투신	-29.9	-111.7	-141.5	0.0	-4.8	-92.8	0.0	0.1	0.0	9.2
은행+보험+기타금융	-20.9	-26.9	-47.8	0.0	-22.7	18.7	-0.1	-0.1	-0.1	0.7
연기금+국가지자체	-58.4	4.7	-53.7	8.9	-10.7	-9.6	0.0	0.0	0.0	28.8
기타법인	17.9	0.3	18.1	0.0	-1.5	23.3	-2.3	0.0	-0.3	-0.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	788,759	206.1	935,565	15.7%	지수옵션 전체	1,659,485	446.2	2,425,079
Put	870,726	240.0	1,489,514	20.1%	PCR(금액기준)	1.16	VKOSPI	19.61%(-0.64%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	360.0(K+3)	1.32	-0.01	115,682	26,087	2,412	15.8	355.0(K+1)
	357.5(K+2)	2.07	-0.05	73,603	20,641	-174	15.9	352.5(K+0)
	355.0(K+1)	3.14	-0.06	48,585	18,619	908	16.3	350.0(K-1)
	352.5(K+0)	4.55	0.05	9,413	10,333	215	17.0	347.5(K-2)
	350.0(K-1)	6.17	0.14	5,303	8,905	-124	17.4	345.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	360.0(K+3)	1.32	-0.01	115,682	26,087	2,412	15.8	355.0(K+1)
	357.5(K+2)	2.07	-0.05	73,603	20,641	-174	15.9	352.5(K+0)
	355.0(K+1)	3.14	-0.06	48,585	18,619	908	16.3	350.0(K-1)
	352.5(K+0)	4.55	0.05	9,413	10,333	215	17.0	347.5(K-2)
	350.0(K-1)	6.17	0.14	5,303	8,905	-124	17.4	345.0(K-3)

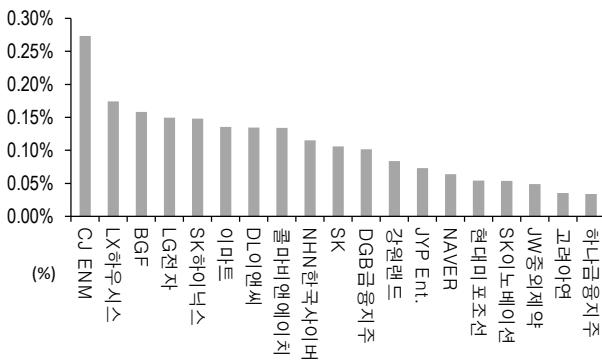
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	2,643,384	1,952.4	4,820,487	-11,441	27,365	3,051	-30,920	-4.3	-4.7	9.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	68,000	0.89	675.6	86.5	1,214,406	-22,181	-0.06%	-13,289	-8,495	23,069
현대차	184,000	0.27	54.4	85.3	59,639	-2,043	-0.01%	2,756	-2,531	-225
SK 하이닉스	109,000	-0.46	223.0	81.7	196,324	7,640	0.15%	10,015	5,617	-15,721
삼성전기	166,000	-0.30	42.0	71.4	32,023	294	0.02%	-821	3,868	-3,047
LG 이노텍	343,500	-0.15	42.2	60.2	11,641	-525	-0.01%	-536	186	350
GS 건설	41,800	-0.24	6.4	56.6	33,501	-3,154	-0.01%	290	-1,463	1,174
POSCO 홀딩스	291,500	0.69	31.3	55.1	18,530	201	-0.22%	189	-343	139
삼성 SDI	612,000	-2.08	68.2	54.7	23,415	-62	-0.08%	-545	-233	782
일진머티리얼즈	86,700	-1.81	10.1	54.7	101,784	-1,850	0.02%	-233	-125	358
KT	35,500	0.85	13.8	54.1	45,694	-2,590	-0.01%	-2,294	-972	3,269

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터