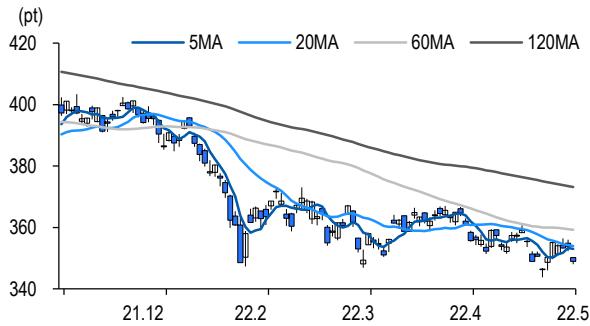


선물옵션시장 지표

2022.5.9

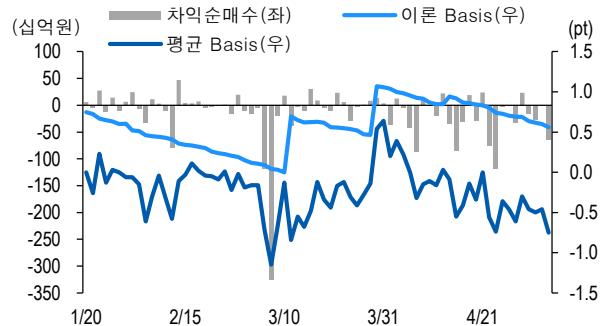
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	349.00	-1.37	-4.85	7,183.2	-
선물 6월물	348.30	-1.48	-5.25	18,956.3	282,303
선물 9월물	348.50	-1.50	-5.30	60.1	12,858
5월물(mini)	348.50	-1.48	-5.24	1,679.4	52,326
6월물(mini)	348.32	-1.48	-5.08	13.3	5,355



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.56	-0.75	-0.70	-0.38%
베이시스(mini)	0.10	-0.54	-0.50	-0.18%
제1스프레드(SP)	0.49	0.00	0.00	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	-0.41	-0.41	-0.15%



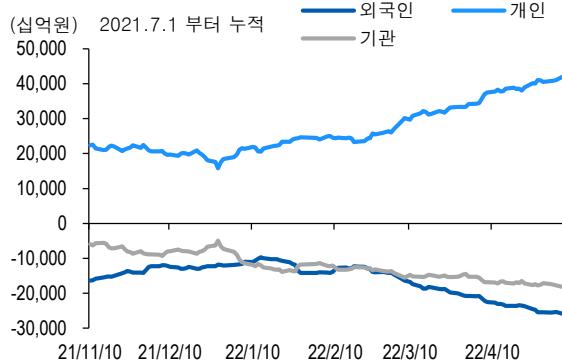
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-479.2	-6.8	-486.0	-41.3	-316.6	-359.0	153.9	1.5	5.7	5.0
개인	762.6	81.9	844.5	0.0	-4.3	30.5	33.2	-1.8	-1.3	-21.4
기관	-300.1	-84.8	-385.0	-23.2	-20.3	373.0	-187.1	0.9	-4.7	18.3
금융투자	-153.4	-119.7	-273.1	-19.7	-10.4	510.9	-186.7	1.1	-4.1	40.6
투신	-34.4	1.8	-32.6	0.0	5.4	-101.1	-0.5	-0.3	-0.2	-19.8
은행+보험+기타금융	-11.8	18.8	6.9	0.0	-10.0	-41.6	0.1	0.2	-0.4	-0.2
연기금+국가지자체	11.5	6.9	18.3	-3.5	-0.1	4.9	0.0	0.0	0.0	-2.2
기타법인	16.8	9.8	26.5	0.0	-4.1	-44.5	0.1	-0.6	0.3	-1.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)									
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정	
Call	1,117,077	201.5	990,286	15.0%	지수옵션 전체		2,289,610	540.4	2,541,995
Put	1,172,533	338.9	1,551,709	19.6%	PCR(금액기준)		1.68	VKOSPI	20.87%(+1.26%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	362.5(K+3)	0.08	-0.63	119,587	33,300	4,932	14.4	357.5(K+1)	9.41
	360.0(K+2)	0.19	-1.13	158,703	37,964	11,877	14.4	355.0(K+0)	7.34
	357.5(K+1)	0.44	-1.63	161,328	28,264	7,623	14.8	352.5(K-1)	5.59
	355.0(K+0)	0.93	-2.21	183,885	27,638	9,019	15.4	350.0(K-2)	4.14
	352.5(K-1)	1.67	-2.88	93,994	13,159	2,826	15.8	347.5(K-3)	3.02
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	357.5(K+1)	9.41	3.50	1,104	4,927	-60	19.7	355.0(K+0)	7.34
	355.0(K+0)	7.34	2.77	5,408	11,138	287	18.9	352.5(K-1)	5.59
	352.5(K-1)	5.59	2.14	8,825	9,852	60	18.8	350.0(K-2)	4.14
	350.0(K-2)	4.14	1.59	26,978	15,422	101	19.1	347.5(K-3)	3.02
	347.5(K-3)	3.02	1.15	66,609	12,738	-484	19.6		

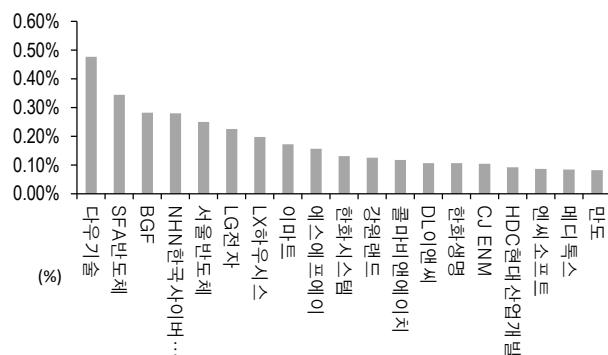
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,917,697	2,072.2	4,855,366	34,879	-18,434	-11,618	33,327	5.0	-21.4	18.3
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	182,500	-0.82	51.5	75.5	59,641	2	-0.11%	319	-59	-260
메리츠증권	6,530	0.31	4.8	60.3	45,628	-11,395	-0.08%	1,592	-3,301	3,544
SK 하이닉스	107,500	-1.38	154.3	58.0	182,460	-13,864	-0.38%	-5,506	-1,875	7,475
LG 전자	115,000	-0.43	31.1	57.9	35,337	-2,839	0.23%	2,909	-2,490	-419
삼성전자	66,400	-2.35	540.8	56.8	1,068,614	-145,792	-0.18%	-7,689	5,990	1,968
일진마티리얼즈	87,000	0.35	12.7	56.5	101,560	-224	-0.10%	-16	-639	655
현대위아	65,000	-0.31	3.0	55.4	6,082	-511	0.02%	596	-595	-1
만도	54,600	0.55	5.6	54.0	8,885	-417	0.08%	226	-55	-171
POSCO 홀딩스	287,000	-1.54	28.8	52.4	16,593	-1,937	-0.15%	-331	-329	675
코스맥스	81,500	0.74	3.1	50.0	8,041	-1,455	0.03%	33	-14	-19

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터