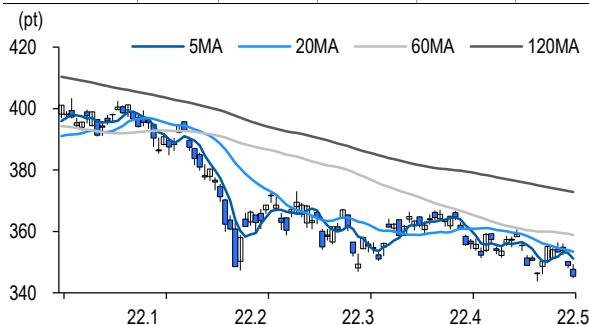


선물옵션시장 지표

2022.5.10

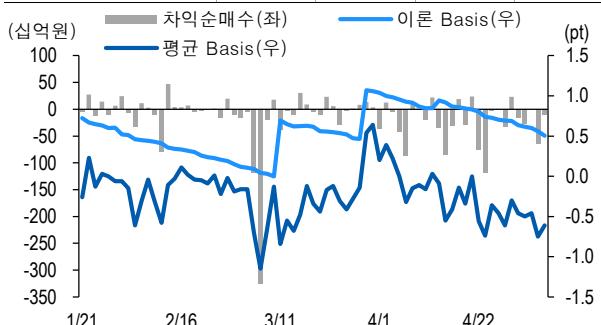
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	345.41	-1.03	-3.59	5,432.1	-
선물 6월물	345.30	-0.86	-3.00	19,299.8	290,364
선물 9월물	345.35	-0.90	-3.15	50.3	12,903
5월물(mini)	345.60	-0.83	-2.90	1,528.2	62,222
6월물(mini)	345.20	-0.89	-3.12	25.0	12,731



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.50	-0.61	-0.11	-0.32%
베이시스(mini)	0.05	-0.34	0.19	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.48	-0.03	-0.05	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.05	0.20	0.20	0.04%



투자주체별 매매 동향 (십억원)

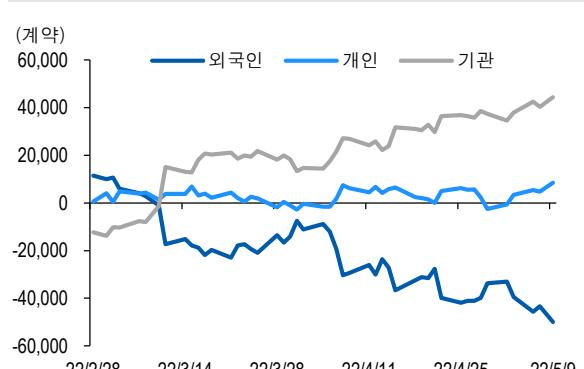
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-227.2	14.5	-212.8	-4.4	-250.1	-342.4	-23.4	-0.2	5.3	3.1
개인	340.8	95.6	436.4	0.0	-3.0	227.6	43.1	-2.0	-0.2	-25.0
기관	-144.3	-124.9	-269.2	-5.2	-95.3	192.8	-23.8	3.2	-5.1	22.0
금융투자	75.4	-113.0	-37.5	-12.0	-28.3	29.1	-23.2	3.0	-4.7	-2.5
투신	3.3	-6.4	-3.1	0.0	2.1	152.2	-0.7	-0.4	0.0	7.7
은행+보험+기타금융	-10.5	16.0	5.5	0.0	-5.4	14.7	0.0	0.6	-0.3	-0.2
연기금+국가지자체	-111.4	-22.7	-134.2	6.9	-69.3	-3.3	0.0	0.0	0.0	17.0
기타법인	30.8	14.8	45.6	0.0	-1.2	-78.0	4.1	-1.0	-0.1	-0.1

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	1,366,698	247.8	1,043,160	18.9%	지수옵션 전체		2,763,564	599.7	2,646,833		
Put	1,396,866	351.9	1,603,673	20.1%	PCR(금액기준)		1.42	VKOSPI	21.39% (+0.52%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	357.5(K+3)	0.10	-0.34	173,520	32,319	4,055	18.3	352.5(K+1)	7.42	1.83	3,781
	355.0(K+2)	0.25	-0.68	281,559	33,532	5,894	18.6	350.0(K+0)	5.49	1.35	14,912
	352.5(K+1)	0.56	-1.11	232,864	22,527	9,368	18.9	347.5(K-1)	3.85	0.83	11,750
	350.0(K+0)	1.10	-1.61	195,628	19,125	6,817	19.3	345.0(K-2)	2.57	0.46	117,532
	347.5(K-1)	2.02	-2.04	97,668	12,379	7,525	20.2	342.5(K-3)	1.67	0.20	144,685
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	352.5(K+1)	7.42	1.83	3,781	9,396	-456	16.9	350.0(K+0)	5.49	1.35	14,912
	350.0(K+2)	5.49	1.35	14,912	14,888	-534	18.1	347.5(K-1)	3.85	0.83	11,750
	352.5(K-1)	3.85	0.83	43,724	11,750	-988	18.8	345.0(K-2)	2.57	0.46	117,532
	350.0(K-0)	2.57	0.46	117,532	18,669	-1,245	19.4	342.5(K-3)	1.67	0.20	144,685
	347.5(K-3)	1.67	0.20	144,685	18,490	1,966	20.3	342.5(K-4)	1.33	0.17	144,685

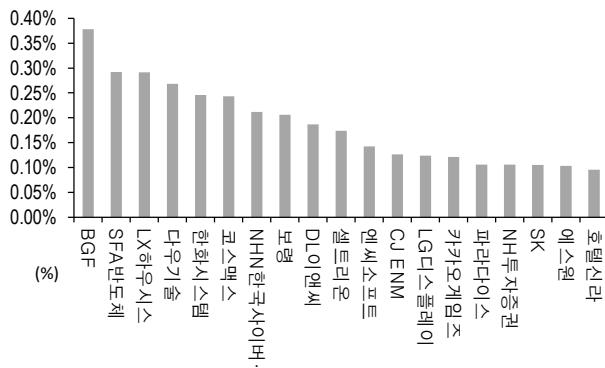
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,639,533	2,665.4	4,878,590	23,224	-10,155	-21,508	32,173	3.1	-25.0	22.0		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	108,000	0.47	218.9	92.4	160,214	-22,246	-0.08%	-812	2,126	-1,027	1,315	-2,100
엔씨소프트	413,500	-0.60	18.5	83.7	9,591	-1,291	0.14%	40	201	-241	-308	-1,009
삼성전자	66,100	-0.45	654.5	83.6	834,014	-234,600	-0.14%	10,150	-12,173	1,624	-10,993	16,150
현대차	181,500	-0.55	76.4	83.6	53,645	-5,996	-0.13%	1,959	-708	-1,211	-320	1,685
코스맥스	78,800	-3.31	3.7	64.0	5,910	-2,131	0.24%	205	-52	-153	-2,351	-91
일진마티리얼즈	83,200	-4.37	13.8	63.7	58,942	-42,618	-0.30%	-1,179	-3,258	4,437	3,510	1,326
삼성 SDI	591,000	-4.21	82.5	59.1	21,923	-1,721	-0.20%	1,022	-2,569	1,550	2,513	393
LG 디스플레이	16,950	0.00	16.6	56.3	205,395	-25,733	0.12%	-1,017	3,205	-2,188	-17,417	-1,279
GS 건설	40,300	-1.95	13.3	54.9	31,276	-2,674	0.03%	3,945	-1,398	-2,447	-3,152	738
LG 전자	113,000	-1.74	43.9	54.4	32,717	-2,620	0.07%	-2,557	2	2,696	-191	2,887

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터