

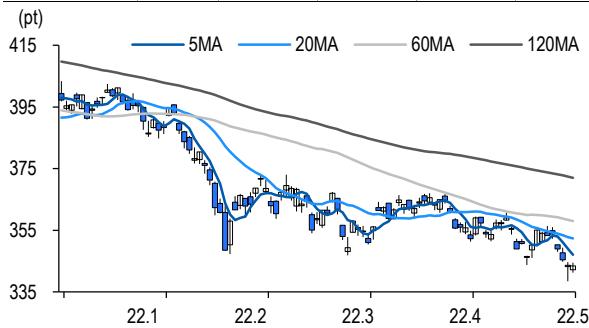


## 선물옵션시장 지표

2022.5.12

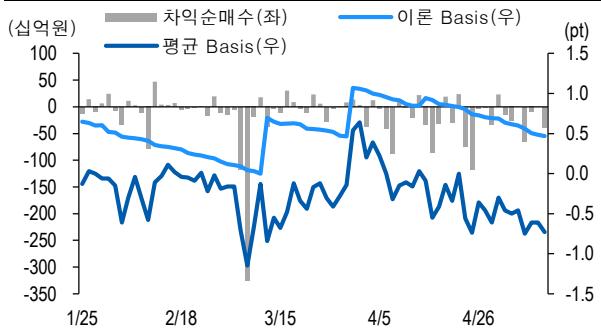
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	343.44	-0.07	-0.23	5,889.3	-
선물 6월물	343.05	-0.01	-0.05	20,630.3	299,065
선물 9월물	343.00	-0.06	-0.20	55.3	12,984
5월물(mini)	343.56	0.00	0.00	1,464.3	60,195
6월물(mini)	343.00	-0.03	-0.14	62.6	24,856



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.47	-0.73	-0.39	-0.35%
베이시스(mini)	0.02	-0.23	0.12	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.46	0.00	0.00	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.02	0.07	0.07	0.02%

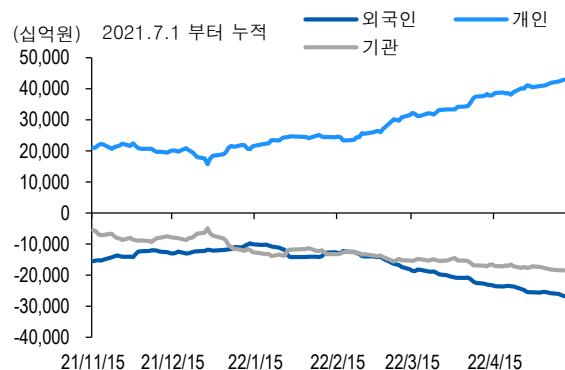


## 투자주체별 매매 동향 (십억원)

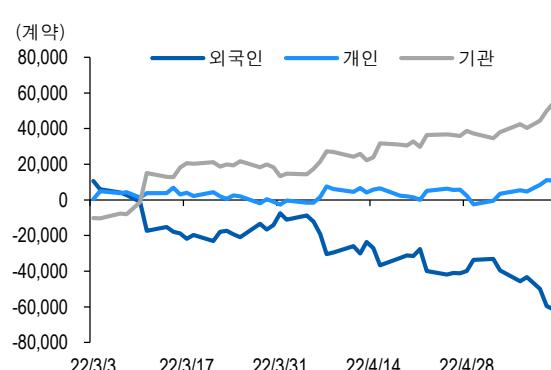
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-288.8	-23.4	-312.2	-13.9	-256.0	-157.1	-1.7	-0.7	4.3	-11.0
개인	345.1	9.7	354.8	0.0	-0.3	-12.8	-12.6	-0.8	-2.5	0.2
기관	-89.3	11.7	-77.5	-25.1	12.9	348.4	14.5	0.9	-1.0	9.5
금융투자	-129.4	-27.5	-156.8	-32.1	1.6	303.1	18.0	1.2	-0.7	-26.5
투신	25.7	9.5	35.2	0.0	20.7	65.6	-3.1	-0.3	-0.1	24.5
은행+보험+기타금융	-2.6	6.8	4.3	0.0	-5.8	-16.0	-0.3	0.0	-0.2	0.0
연기금+국가지자체	0.7	6.6	7.2	7.0	-1.4	-4.3	0.0	0.0	0.0	11.4
기타법인	32.9	2.0	34.9	0.0	-0.6	-178.5	-0.2	0.5	-0.8	1.3

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	1,825,152	310.3	1,200,415	17.3%	지수옵션 전체	3,495,377	590.8	2,940,300
Put	1,670,225	280.5	1,739,885	18.2%	PCR(금액기준)	0.90	VKOSPI	21.10%(-1.01%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	350.0(K+3)	0.13	-0.21	335,224	42,275	9,784	17.0	345.0(K+1)
	347.5(K+2)	0.45	-0.38	441,450	32,747	10,872	17.5	342.5(K+0)
	345.0(K+1)	1.12	-0.51	365,617	25,618	4,773	17.5	340.0(K-1)
	342.5(K+0)	2.30	-0.60	193,673	12,899	2,255	17.5	337.5(K-2)
	340.0(K-1)	4.08	-0.52	43,650	7,618	227	18.3	335.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	345.0(K+1)	2.62	-0.43	57,936	17,083	283	17.2	
	342.5(K+0)	1.29	-0.53	197,836	20,541	3,018	17.1	
	340.0(K-1)	0.53	-0.44	330,172	36,685	2,904	17.3	
	337.5(K-2)	0.20	-0.27	355,776	35,283	-2,495	18.0	
	335.0(K-3)	0.08	-0.16	238,690	45,730	8,591	19.4	

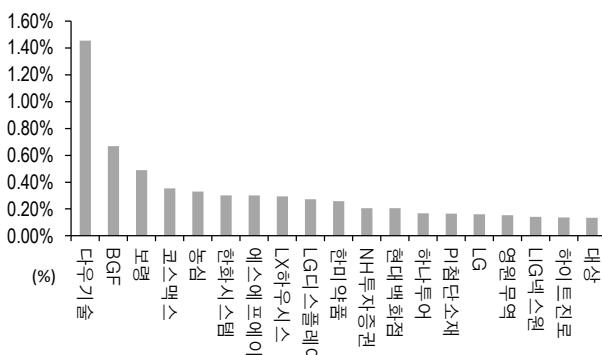
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	4,200,304	3,096.8	5,285,524	427,636	-36,286	6,600	25,499	-11.0	0.2	9.5
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	183,000	1.39	139.3	105.7	45,963	-4,297	-0.09%	3,114	-1,575	-1,537
삼성전자	65,800	0.00	659.2	81.2	587,286	-67,128	-0.13%	5,394	5,211	-10,820
SK 하이닉스	111,500	1.36	281.6	69.7	144,765	-13,591	-0.02%	-8,549	-668	9,010
LG 생활건강	808,000	0.50	34.6	66.2	10,257	1,184	-0.41%	176	-919	753
NAVER	279,000	0.72	79.6	60.8	19,698	-7,858	0.11%	665	-939	275
삼성전기	160,500	0.00	27.0	56.7	13,087	-3,117	-0.14%	-1,006	2,268	-1,252
GS 건설	39,300	-1.13	13.2	55.6	18,440	-7,817	0.03%	509	-2,392	1,913
엔씨소프트	413,500	1.35	15.1	54.0	7,211	-1,961	0.05%	-126	-45	171
호텔신라	76,100	0.26	12.9	52.8	9,833	-3,161	0.02%	740	1,499	-2,270
카카오	85,700	2.27	59.5	51.4	42,859	-9,225	0.03%	-346	1,706	-1,360

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터