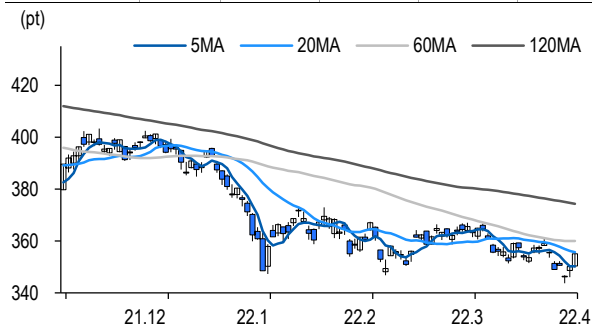


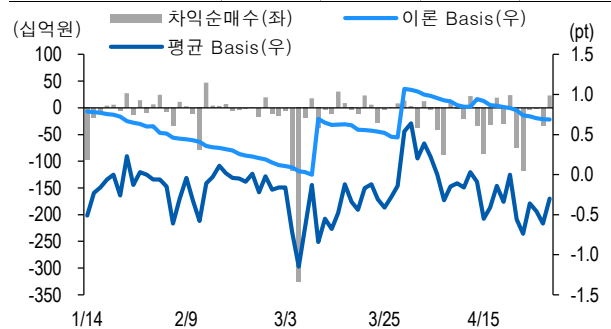
선물옵션시장 지표

2022.5.2

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	355.08	1.41	4.92	7,934.0	-
선물 6월물	355.60	1.63	5.70	20,720.1	274,080
선물 9월물	355.45	1.69	5.90	55.3	12,692
5월물(mini)	355.50	1.61	5.62	1,515.2	53,098
6월물(mini)	355.34	1.55	5.44	30.3	4,214



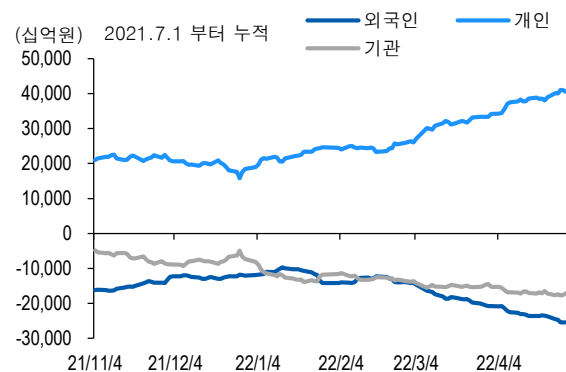
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.69	-0.30	0.52	-0.28%
베이스(mini)	0.22	-0.31	0.42	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.52	0.04	0.05	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.22	0.29	0.29	0.02%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	13.7	2.3	16.0	11.8	49.2	656.2	-112.3	2.7	0.3	-15.6
개인	-486.6	-1.7	-488.3	0.0	4.5	-387.6	-36.3	1.7	-2.6	46.2
기관	490.9	-2.4	488.5	11.2	27.2	-266.7	150.9	-5.0	3.4	-30.1
금융투자	203.8	-17.6	186.2	-10.1	-0.1	-450.1	148.1	-4.9	3.1	-25.7
투신	79.6	5.0	84.5	0.0	19.9	206.1	3.0	-0.1	0.2	-4.8
은행+보험+기타금융	-7.5	9.3	1.8	0.0	-6.7	8.2	-0.1	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	116.6	3.0	119.6	21.3	10.0	-30.9	0.0	0.0	0.0	0.3
기타법인	-18.0	1.8	-16.2	0.0	0.3	-1.9	-2.3	0.7	-1.0	-0.4

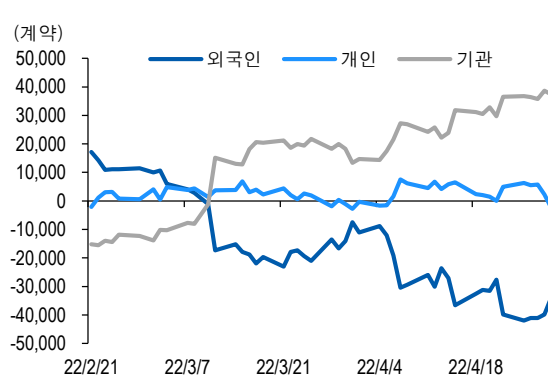
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,133,559	334.2	865,165	15.6%	지수옵션 전체	2,114,953	573.0	2,184,282
Put	981,394	238.7	1,319,117	18.9%	PCR(금액기준)	0.71	VKOSPI	18.92%(-1.53%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	357.5(K+3)	3.42	1.70	81,251	19,146	-242	15.9	Put	352.5(K+1)	3.34	-3.00	11,570	7,225	1,177	16.7
	355.0(K+2)	4.70	2.12	56,567	17,528	-2,117	16.4		350.0(K+0)	2.60	-2.59	36,204	13,566	1,879	17.4
	352.5(K+1)	6.17	2.47	16,805	9,288	-43	16.8		347.5(K-1)	2.00	-2.17	28,000	8,856	1,487	18.1
	350.0(K+0)	7.97	2.97	9,661	9,384	14	17.7		345.0(K-2)	1.54	-1.81	49,564	18,082	2,328	18.8
	347.5(K-1)	9.88	3.41	4,046	3,692	72	18.4		342.5(K-3)	1.18	-1.48	48,332	10,314	585	19.4

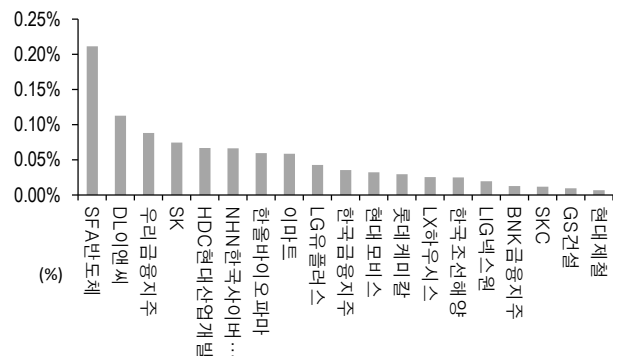
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 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	3,865,137	2,867.1	4,803,493	-6,465	-10,562	31,999	-21,972	-15.6	46.2	-30.1	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	187,000	-1.06	121.7	85.7	58,754	1,188	0.01%	65	-505	457	2,828	-2,293
삼성전자	67,400	3.53	1,232.2	70.7	1,247,588	-14,460	-0.06%	12,366	44,527	-54,142	-55,472	2,210
메리츠증권	6,530	-1.36	5.5	66.0	61,788	8,517	-0.21%	5,366	-9,817	-74	-1,786	0
일진머티리얼즈	88,300	1.49	10.6	60.8	106,938	478	0.00%	-9	2,174	-2,190	-1,480	-710
호텔신라	81,300	0.00	7.5	56.4	25,660	195	-0.04%	351	311	-662	-183	-250
GS 건설	42,150	-1.17	9.9	56.4	42,406	311	0.01%	-666	3,355	-3,159	-1,203	-1,956
삼성전기	166,000	2.15	60.3	54.6	28,880	-2,052	-0.06%	2,197	175	-2,372	-3,896	332
SK 하이닉스	112,500	2.27	224.1	53.7	186,222	5,953	0.00%	948	5,109	-6,303	-7,118	-2,000
삼성 SDI	612,000	2.51	123.0	49.7	22,730	-1,982	-0.15%	-184	1,544	-1,356	-1,827	970
하나금융지주	47,100	-0.84	16.9	47.4	94,719	-239	0.01%	-1,751	1,930	-179	2,020	-2,199

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터