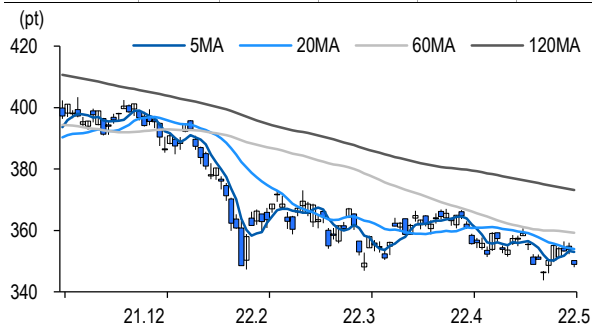


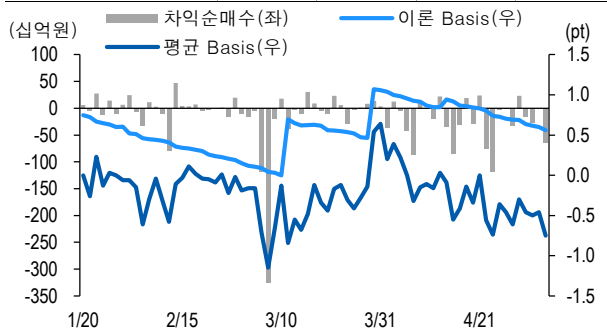
선물옵션시장 지표

2022.5.9

| Market Data (십억원, 계약) | | | | | |
|-----------------------|--------|--------|---------|----------|---------|
| | 증가(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 |



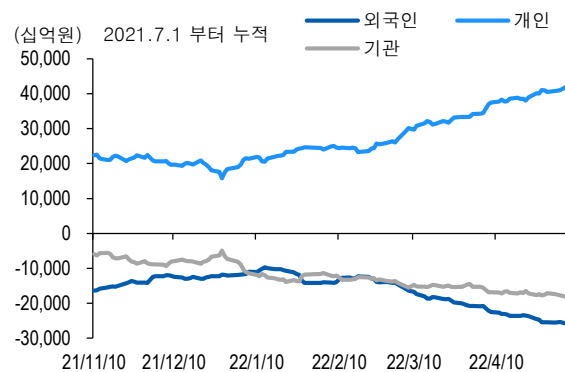
| 차익거래 관련 Market data (pt) | | | | |
|--------------------------|------|-------|-------|--------|
| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 과리율(%) |
| K200 베이스 | 0.56 | -0.75 | -0.70 | -0.38% |
| 베이스(mini) | 0.10 | -0.54 | -0.50 | -0.18% |
| 제1스프레드(SP) | 0.49 | 0.00 | 0.00 | -0.14% |
| 합성선물 베이스(ATM) | 0.10 | -0.41 | -0.41 | -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 |

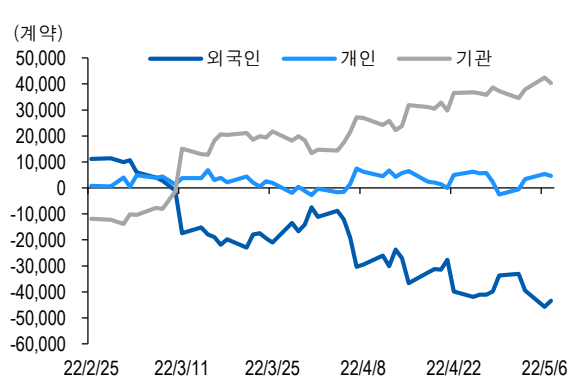
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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) |

| | 행사가 | 증가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | | 행사가 | 증가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 |
|------|------------|------|--------|---------|--------|--------|-------|-----|------------|------|--------|--------|--------|-------|-------|
| Call | 362.5(K+3) | 0.08 | -0.63 | 119,587 | 33,300 | 4,932 | 14.4 | Put | 357.5(K+1) | 9.41 | 3.50 | 1,104 | 4,927 | -60 | 19.7 |
| | 360.0(K+2) | 0.19 | -1.13 | 158,703 | 37,964 | 11,877 | 14.4 | | 355.0(K+0) | 7.34 | 2.77 | 5,408 | 11,138 | 287 | 18.9 |
| | 357.5(K+1) | 0.44 | -1.63 | 161,328 | 28,264 | 7,623 | 14.8 | | 352.5(K-1) | 5.59 | 2.14 | 8,825 | 9,852 | 60 | 18.8 |
| | 355.0(K+0) | 0.93 | -2.21 | 183,885 | 27,638 | 9,019 | 15.4 | | 350.0(K-2) | 4.14 | 1.59 | 26,978 | 15,422 | 101 | 19.1 |
| | 352.5(K-1) | 1.67 | -2.88 | 93,994 | 13,159 | 2,826 | 15.8 | | 347.5(K-3) | 3.02 | 1.15 | 66,609 | 12,738 | -484 | 19.6 |

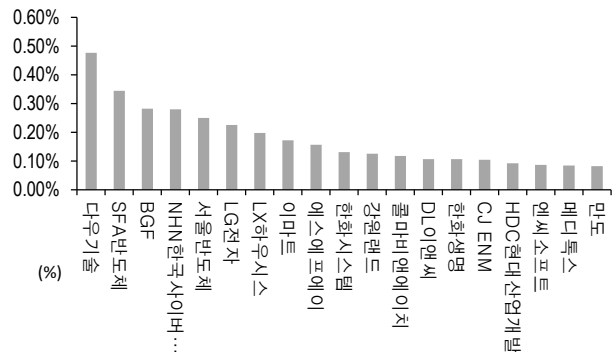
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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 | 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 (%) | 외국인 순매수 | 개인 순매수 | 기관 순매수 | 금융투자 순매수 | 연기금등 순매수 |
|-----------|--------------|------------|-----------------|-------------|---------------|---------------|--------------|------------|-----------|-----------|-------------|-------------|
| 현대차 | 182,500 | -0.82 | 51.5 | 75.5 | 59,641 | 2 | -0.11% | 319 | -59 | -260 | 879 | -471 |
| 메리츠증권 | 6,530 | 0.31 | 4.8 | 60.3 | 45,628 | -11,395 | -0.08% | 1,592 | -3,301 | 3,544 | 4,148 | -604 |
| SK 하이닉스 | 107,500 | -1.38 | 154.3 | 58.0 | 182,460 | -13,864 | -0.38% | -5,506 | -1,875 | 7,475 | 9,866 | 3,100 |
| LG 전자 | 115,000 | -0.43 | 31.1 | 57.9 | 35,337 | -2,839 | 0.23% | 2,909 | -2,490 | -419 | -1,838 | -2,476 |
| 삼성전자 | 66,400 | -2.35 | 540.8 | 56.8 | 1,068,614 | -145,792 | -0.18% | -7,689 | 5,990 | 1,968 | 24,598 | -19,396 |
| 일진머티리얼즈 | 87,000 | 0.35 | 12.7 | 56.5 | 101,560 | -224 | -0.10% | -16 | -639 | 655 | -143 | 1,192 |
| 현대위아 | 65,000 | -0.31 | 3.0 | 55.4 | 6,082 | -511 | 0.02% | 596 | -595 | -1 | -497 | 496 |
| 만도 | 54,600 | 0.55 | 5.6 | 54.0 | 8,885 | -417 | 0.08% | 226 | -55 | -171 | -2,371 | -369 |
| POSCO 홀딩스 | 287,000 | -1.54 | 28.8 | 52.4 | 16,593 | -1,937 | -0.15% | -331 | -329 | 675 | 741 | -485 |
| 코스맥스 | 81,500 | 0.74 | 3.1 | 50.0 | 8,041 | -1,455 | 0.03% | 33 | -14 | -19 | -19 | 0 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터