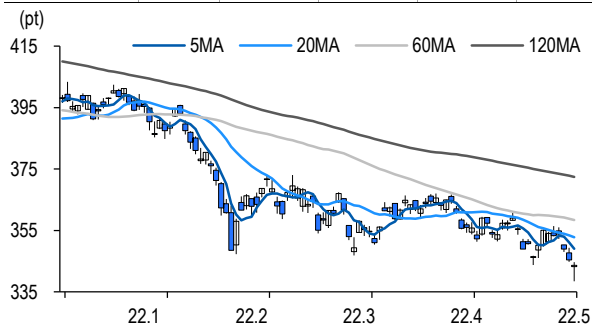


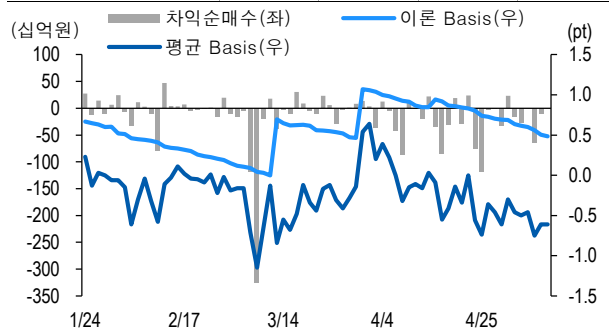
선물옵션시장 지표

2022.5.11

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	343.67	-0.50	-1.74	7,315.2	-
선물 6월물	343.10	-0.64	-2.20	28,566.2	300,478
선물 9월물	343.20	-0.62	-2.15	80.1	12,991
5월물(mini)	343.56	-0.59	-2.04	2,003.4	61,549
6월물(mini)	343.14	-0.63	-2.06	65.8	23,771



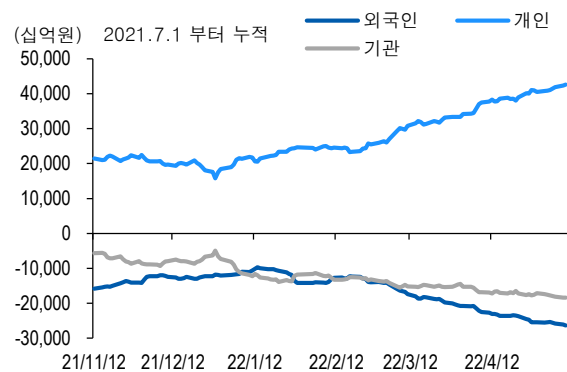
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.49	-0.61	-0.57	-0.32%
베이스(mini)	0.03	-0.27	-0.11	-0.09%
제1스프레드(SP)	0.47	-0.01	0.00	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.03	-0.09	-0.09	-0.04%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-319.6	4.0	-315.7	-1.2	-222.1	-811.0	-8.7	-1.4	-0.4	20.0
개인	284.9	-10.1	274.9	0.0	-8.0	182.1	34.3	0.5	3.7	8.4
기관	7.5	-20.7	-13.1	1.9	-3.3	505.4	-33.2	1.0	-4.4	-28.1
금융투자	95.2	-74.3	20.9	1.6	11.0	287.9	-33.8	3.6	-3.7	-60.8
투신	3.5	16.5	20.0	0.0	9.8	189.1	0.7	-0.8	-0.5	49.9
은행+보험+기타금융	-14.7	27.1	12.4	0.0	-14.2	16.8	-0.2	-1.8	-0.3	0.4
연기금+국가자재	-0.9	8.1	7.2	0.3	-15.2	11.6	0.0	0.0	0.0	-17.6
기타법인	27.2	26.7	53.9	0.0	-1.9	123.5	7.6	-0.2	1.1	-0.3

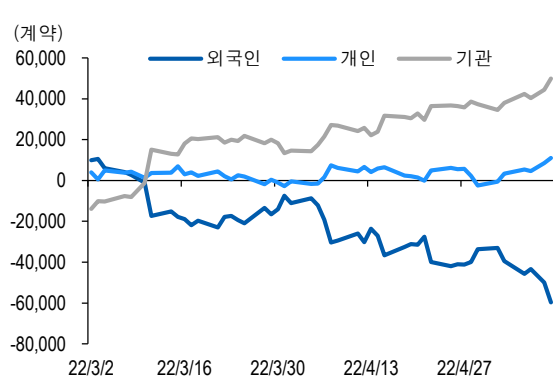
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



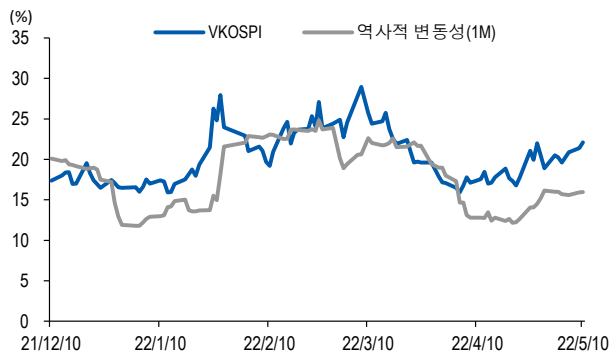
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,135,842	395.4	1,141,654	17.7%	지수옵션 전체	4,352,031	906.8	2,790,923
Put	2,216,189	511.4	1,649,269	19.7%	PCR(금액기준)	1.29	VKOSPI	22.11%(+0.72%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	352.5(K+3)	0.13	-0.43	253,527	30,409	7,882	17.5	Put	347.5(K+1)	4.73	0.88	10,399	11,268	-482	19.0
	350.0(K+2)	0.34	-0.76	331,215	32,491	13,366	17.4		345.0(K+0)	3.05	0.48	40,133	16,800	-1,869	18.9
	347.5(K+1)	0.83	-1.19	428,715	21,875	9,496	17.8		342.5(K-1)	1.82	0.15	99,203	17,523	-967	19.2
	345.0(K+0)	1.63	-1.62	362,991	20,845	14,416	17.8		340.0(K-2)	0.97	-0.06	235,202	33,781	1,098	19.3
	342.5(K-1)	2.90	-1.89	190,040	10,644	8,954	18.0		337.5(K-3)	0.47	-0.13	295,404	37,778	-10,164	19.5

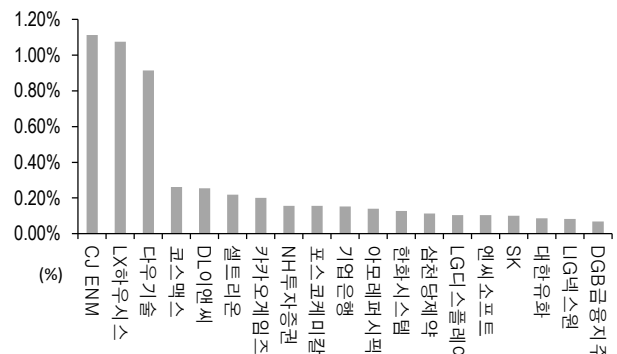
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,331,504	3,253.0	4,857,888	-20,702	14,750	21,737	-36,537	20.0	8.4	-28.1	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	180,500	-0.55	114.9	83.4	50,260	-3,385	-0.10%	-1,271	1,139	132	192	1,550
LG 디스플레이	17,200	1.47	30.1	71.0	172,430	-32,965	0.10%	5,499	5,676	-11,175	-37,051	-888
삼성전자	65,800	-0.45	799.8	70.8	654,414	-179,600	-0.14%	4,591	16,203	-20,944	-5,063	-17,207
LG 생활건강	804,000	0.75	37.6	67.3	9,073	0	-0.21%	204	-1,258	1,044	246	-25
SK 하이닉스	110,000	1.85	274.6	61.4	158,356	-1,858	0.00%	9,396	-10,100	861	-2,326	0
호텔신라	75,900	-0.13	15.5	56.2	12,994	-6,385	0.04%	1,595	432	-1,977	-6,829	744
카카오	83,800	-0.59	109.7	55.4	52,084	-35,045	0.07%	3,148	874	-4,022	-21,152	-3,328
일진머티리얼즈	82,900	-0.36	15.1	54.5	46,918	-12,024	-0.23%	574	-2,672	2,119	2,127	84
삼성전기	160,500	0.00	37.9	52.8	16,204	-3,977	0.02%	1,711	-2,188	477	982	-505
삼성 SDI	594,000	0.51	112.3	51.5	20,588	-1,335	-0.05%	63	1,177	-1,243	-1,199	-359

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터