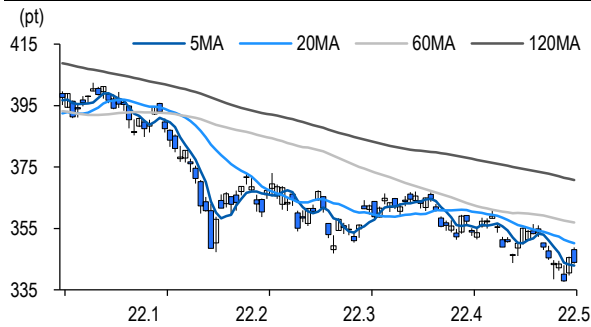


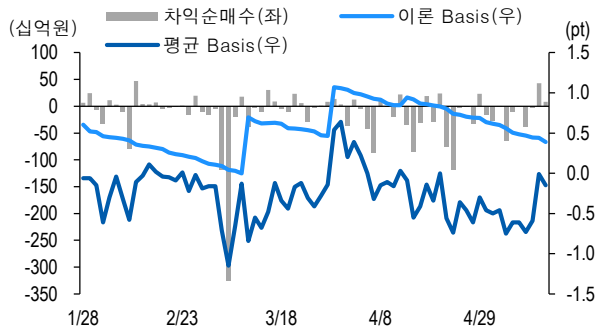
선물옵션시장 지표

2022.5.17

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	343.94	-0.45	-1.56	5,299.4	-
선물 6월물	344.15	-0.45	-1.55	23,923.0	288,983
선물 9월물	344.05	-0.43	-1.50	149.8	13,436
6월물(mini)	344.10	-0.46	-1.68	1,718.1	51,548
7월물(mini)	344.00	-0.34	-1.18	4.0	4,512

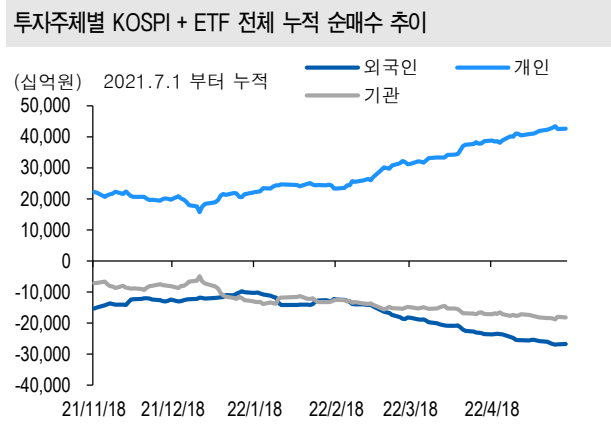


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.39	-0.15	0.21	-0.16%	
베이스스(mini)	0.39	-0.15	0.16	-0.16%	
제1스프레드(SP)	0.47	-0.04	-0.05	-0.15%	
합성선물 베이스스(ATM)	0.39	0.07	0.18	-0.09%	

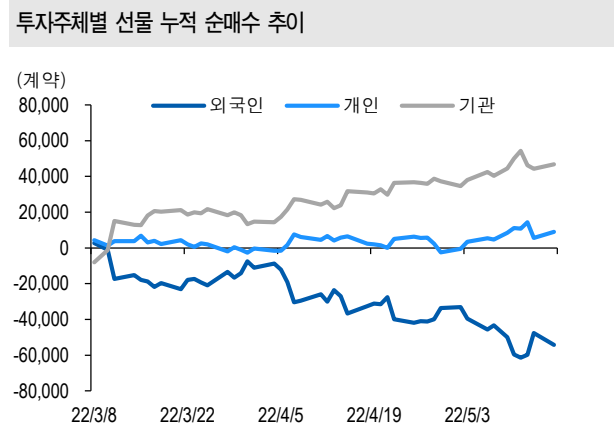


투자주체별 매매 동향		(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체	
외국인	-17.9	88.5	70.5	4.7	-61.5	-486.5	-72.3	-2.0	-27.6	-7.1	
개인	64.9	-17.6	47.3	0.0	0.1	276.0	42.7	-0.4	24.8	75.7	
기관	-101.4	-74.1	-175.5	3.8	-60.7	103.0	28.0	2.4	2.9	-69.8	
금융투자	-102.0	-70.9	-172.9	3.8	3.1	180.3	29.3	2.2	3.0	-38.0	
투신	-8.8	4.4	-4.4	0.0	-7.2	-66.4	0.7	0.0	0.0	1.2	
은행+보험+기타금융	-17.2	0.9	-16.3	0.0	-13.7	3.5	-2.1	0.2	-0.1	0.0	
연기금+국가지자체	14.1	-0.7	13.4	0.0	-11.4	-14.4	0.0	0.0	0.0	-33.0	
기타법인	54.5	3.2	57.7	0.0	-0.7	107.5	1.6	-0.1	-0.1	1.2	

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



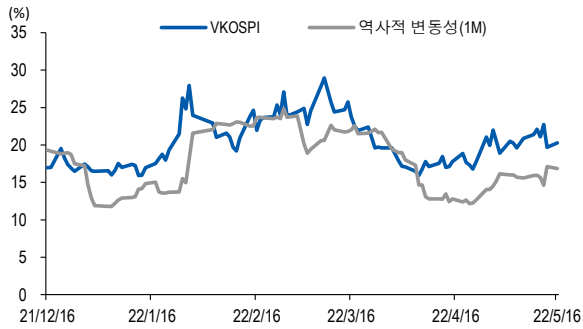
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	649,059	217.8	709,298	16.9%	지수옵션 전체	1,374,416	517.2	1,832,949
Put	725,357	299.4	1,123,651	19.1%	PCR(금액기준)	1.37	VKOSPI	20.27%(+0.58%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	352.5(K+3)	2.84	-0.72	25,038	7,876	545	16.7	Put	347.5(K+1)	8.25	0.75	9,101	5,252	4,278	18.2
	350.0(K+2)	3.83	-0.75	20,819	12,900	1,072	17.3		345.0(K+0)	6.94	0.58	9,331	10,454	1,150	18.4
	347.5(K+1)	4.81	-0.96	12,346	4,256	989	17.4		342.5(K-1)	5.87	0.45	10,248	3,155	820	18.9
	345.0(K+0)	6.06	-1.08	6,560	11,197	1,017	17.8		340.0(K-2)	4.93	0.32	15,426	18,868	-470	19.3
	342.5(K-1)	7.46	-1.24	1,299	2,365	55	18.1		337.5(K-3)	4.16	0.27	17,863	4,034	702	19.9

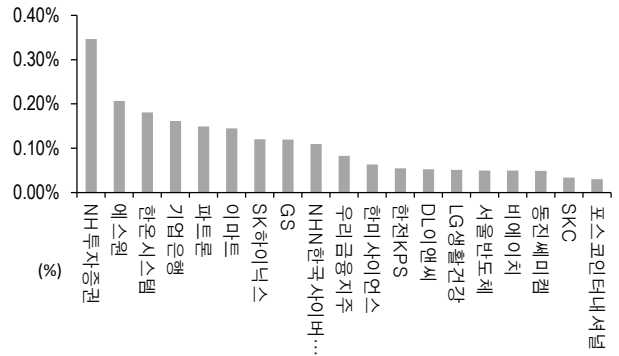
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	3,147,340	2,344.0	4,318,751	138,957	7,762	60,089	-69,157	-7.1	75.7	-69.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	184,000	-1.34	102.5	101.1	50,035	-2,116	-0.17%	1,398	2,496	-3,873	1,558	-274
SK 하이닉스	111,000	-1.77	432.0	99.1	207,129	16,243	0.12%	-3,990	27,956	-24,016	-24,071	-300
영진약품	4,590	-0.22	1.8	94.4	8,349	-3,558	-0.15%	2,779	164	-2,943	-2,943	0
삼성전자	66,500	0.15	737.4	92.8	1,243,143	12,522	-0.16%	-933	-16,510	15,996	3,403	-15,028
GS 건설	39,450	-1.00	9.4	84.5	34,437	-66	-0.07%	625	-163	-662	367	-1,029
삼성 SDI	589,000	-0.17	68.6	83.0	20,650	446	-0.05%	-1,052	954	95	-630	-162
일진머티리얼즈	81,500	1.62	15.4	79.3	83,956	1,277	-0.19%	-1,121	1,994	-909	-136	-683
LG 이노텍	339,500	0.89	57.4	67.6	10,451	692	-0.11%	-31	127	-102	277	-414
LG 디스플레이	17,000	-1.45	18.1	67.4	102,824	23,031	-0.56%	1,743	421	-2,166	21,156	2,673
삼성전기	158,000	-1.56	34.0	66.0	31,033	2,061	0.00%	-1,466	3,452	-1,993	-560	-1,433

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터