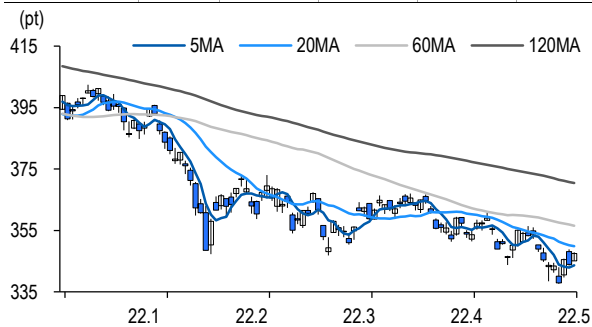


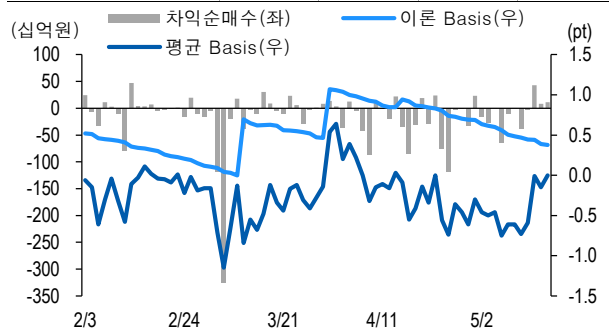
## 선물옵션시장 지표

2022.5.18

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	347.53	1.04	3.59	5,807.7	-
선물 6월물	347.60	1.00	3.45	16,949.5	292,778
선물 9월물	347.60	1.03	3.55	152.5	13,566
6월물(mini)	347.56	0.99	3.46	1,257.5	55,381
7월물(mini)	347.08	0.90	3.08	7.6	4,426



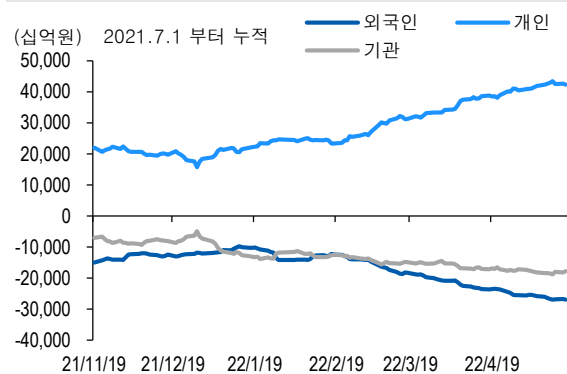
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.38	0.00	0.07	-0.11%
베이스(mini)	0.38	0.00	0.03	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.49	-0.05	-0.05	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.38	0.01	0.01	-0.11%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-159.9	-2.1	-162.0	4.2	-113.3	105.6	58.9	2.4	-1.7	10.8
개인	-304.8	48.7	-256.1	0.0	-5.8	-127.7	-39.5	-2.4	0.5	7.8
기관	461.9	-48.7	413.2	7.3	-24.5	-22.9	-10.9	-0.3	1.3	-23.3
금융투자	459.4	-48.8	410.6	2.2	0.0	-292.3	-11.4	-0.3	1.5	-3.8
투신	-8.8	5.3	-3.5	0.0	-2.7	289.0	0.5	0.0	-0.1	9.6
은행+보험+기타금융	-19.7	-5.4	-25.1	0.0	-3.8	-11.0	0.1	0.0	0.0	0.3
연기금+국가자재	18.7	0.2	18.9	5.1	-11.7	-8.6	0.0	0.0	0.0	-29.4
기타법인	2.8	2.0	4.8	0.0	-1.3	45.1	-8.5	0.3	-0.2	4.6

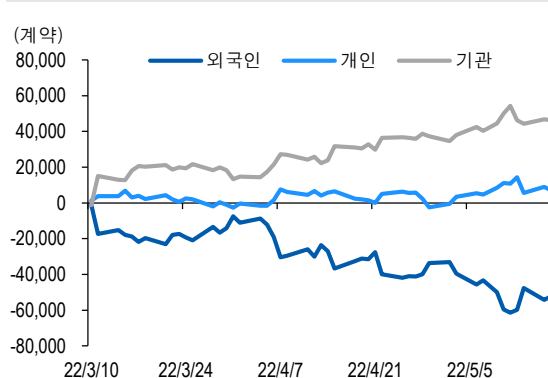
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	513,117	181.0	744,920	15.9%	지수옵션 전체	1,051,635	340.3	1,923,656
Put	538,518	159.3	1,178,736	18.9%	PCR(금액기준)	0.88	VKOSPI	19.06%(-1.21%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	352.5(K+3)	3.72	0.88	22,162	8,190	314	16.0	Put	347.5(K+1)	6.06	-2.19	4,412	5,984	732	17.6
	350.0(K+2)	4.72	0.89	13,123	14,053	1,153	16.0		345.0(K+0)	5.06	-1.88	6,765	10,750	296	18.1
	347.5(K+1)	6.05	1.24	7,534	5,010	754	16.4		342.5(K-1)	4.17	-1.70	7,432	3,580	425	18.5
	345.0(K+0)	7.60	1.54	5,118	11,057	-140	17.0		340.0(K-2)	3.40	-1.53	14,480	20,284	1,416	18.8
	342.5(K-1)	9.19	1.73	1,812	2,474	109	17.3		337.5(K-3)	2.79	-1.37	17,096	5,001	967	19.3

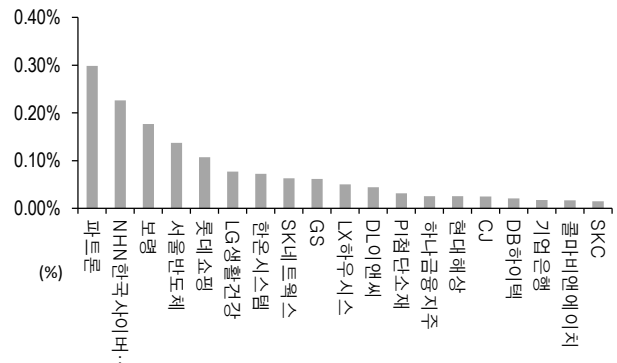
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	3,005,232	1,996.6	4,470,193	147,286	4,533	1,930	-7,621	10.8	7.8	-23.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	67,700	2.11	847.0	80.5	1,285,447	40,573	-0.10%	-319	19,162	-27,109	-25,490	-25,700
영진약품	4,530	-1.31	0.8	78.4	9,046	697	-0.15%	-186	-1,321	1,510	1,510	0
현대차	185,500	0.82	67.3	68.9	49,522	-513	-0.09%	-1,567	442	1,125	844	250
삼성전기	162,000	2.53	26.9	64.5	30,707	-324	0.00%	1,918	711	-2,625	-295	-2,330
엔씨소프트	422,000	0.24	24.2	61.6	10,301	362	-0.03%	315	141	-466	-342	993
일진머티리얼즈	87,000	6.88	24.6	59.9	85,221	1,256	-0.11%	1,142	-436	-695	-1,131	-694
SK 하이닉스	113,000	2.26	131.7	58.6	207,758	-670	-0.04%	9,317	-9,324	-443	-1,797	200
LG 이노텍	343,000	0.88	23.0	55.9	10,352	-101	-0.06%	771	-532	-119	-15	-104
GS 건설	39,450	0.00	9.9	55.6	34,222	-215	-0.03%	930	733	-1,313	780	-2,098
LG 화학	505,000	0.00	39.1	48.9	8,663	463	-0.01%	512	-42	-471	-50	-421

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터