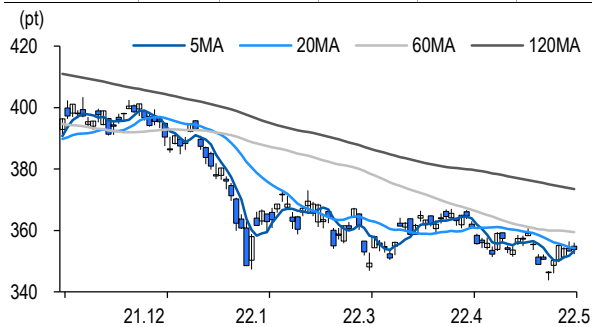


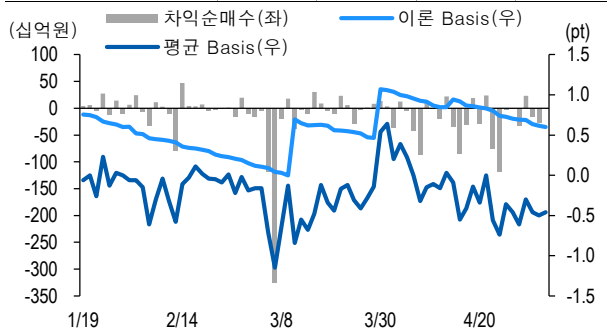
선물옵션시장 지표

2022.5.6

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	353.85	0.15	0.53	5,532.8	-
선물 6월물	353.55	0.20	0.70	16,894.5	276,265
선물 9월물	353.80	0.34	1.20	53.7	12,820
5월물(mini)	353.74	0.25	0.88	1,670.6	54,695
6월물(mini)	353.40	0.15	0.42	41.5	4,922



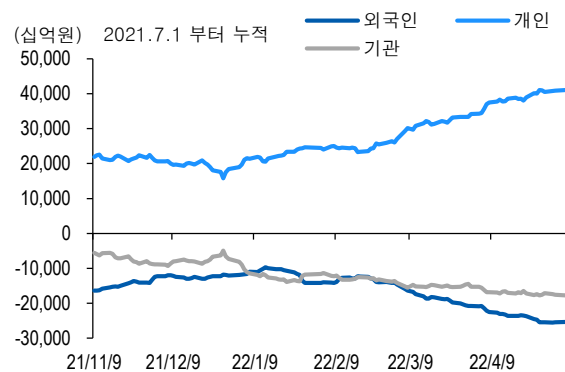
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.60	-0.46	-0.30	-0.30%
베이스(mini)	0.13	-0.32	-0.11	-0.13%
제1스프레드(SP)	0.51	-0.00	0.00	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.13	-0.25	-0.25	-0.11%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	31.4	3.6	35.0	-3.9	61.5	-341.8	1.0	-3.5	0.7	-4.3
개인	100.9	2.7	103.6	0.0	-4.4	118.2	-7.2	1.4	0.9	-4.7
기관	-150.2	-6.5	-156.7	4.5	-46.9	200.3	8.5	2.1	-1.3	9.7
금융투자	64.4	121.2	185.7	-4.4	1.8	284.0	8.5	2.2	-1.2	-29.0
투신	-29.9	-111.7	-141.5	0.0	-4.8	-92.8	0.0	0.1	0.0	9.2
은행+보험+기타금융	-20.9	-26.9	-47.8	0.0	-22.7	18.7	-0.1	-0.1	-0.1	0.7
연기금+국가지자체	-58.4	4.7	-53.7	8.9	-10.7	-9.6	0.0	0.0	0.0	28.8
기타법인	17.9	0.3	18.1	0.0	-1.5	23.3	-2.3	0.0	-0.3	-0.7

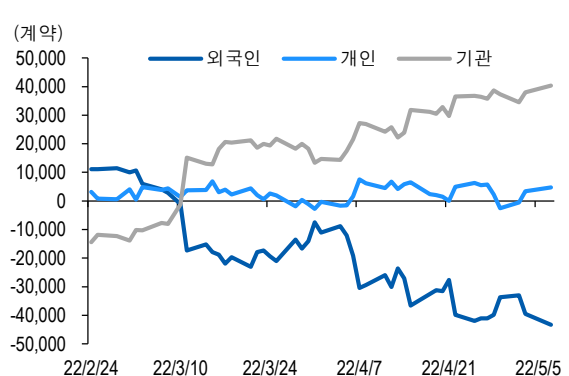
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



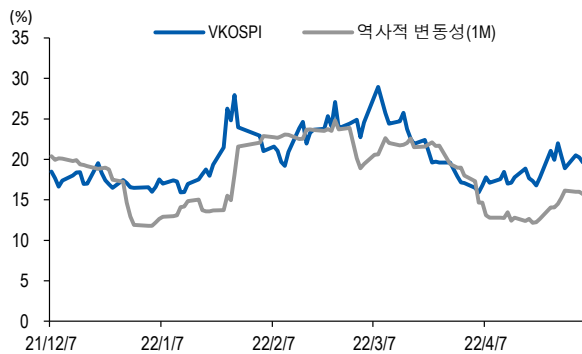
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	788,759	206.1	935,565	15.7%	지수옵션 전체	1,659,485	446.2	2,425,079
Put	870,726	240.0	1,489,514	20.1%	PCR(금액기준)	1.16	VKOSPI	19.61%(-0.64%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	360.0(K+3)	1.32	-0.01	115,682	26,087	2,412	15.8	Put	355.0(K+1)	4.57	-0.79	12,693	10,851	297	18.2
	357.5(K+2)	2.07	-0.05	73,603	20,641	-174	15.9		352.5(K+0)	3.45	-0.71	25,647	9,792	730	18.8
	355.0(K+1)	3.14	-0.06	48,585	18,619	908	16.3		350.0(K-1)	2.55	-0.71	64,051	15,321	-562	19.3
	352.5(K+0)	4.55	0.05	9,413	10,333	215	17.0		347.5(K-2)	1.87	-0.58	63,838	13,222	2,312	19.9
	350.0(K-1)	6.17	0.14	5,303	8,905	-124	17.4		345.0(K-3)	1.36	-0.45	76,703	20,002	1,176	20.6

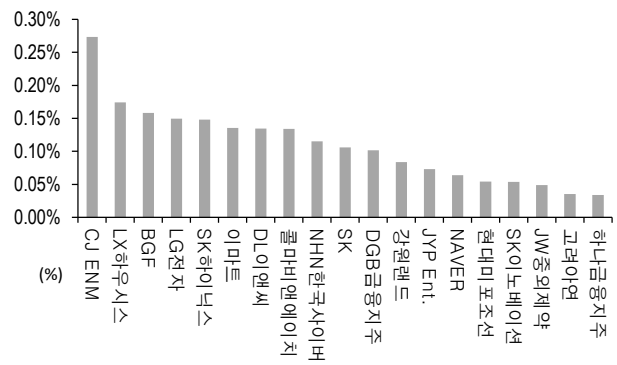
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,643,384	1,952.4	4,820,487	-11,441	27,365	3,051	-30,920	-4.3	-4.7	9.7	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	68,000	0.89	675.6	86.5	1,214,406	-22,181	-0.06%	-13,289	-8,495	23,069	-13,109	24,453
현대차	184,000	0.27	54.4	85.3	59,639	-2,043	-0.01%	2,756	-2,531	-225	-1,547	1,422
SK 하이닉스	109,000	-0.46	223.0	81.7	196,324	7,640	0.15%	10,015	5,617	-15,721	-15,390	-950
삼성전기	166,000	-0.30	42.0	71.4	32,023	294	0.02%	-821	3,868	-3,047	-1,731	-1,316
LG 이노텍	343,500	-0.15	42.2	60.2	11,641	-525	-0.01%	-536	186	350	-105	620
GS 건설	41,800	-0.24	6.4	56.6	33,501	-3,154	-0.01%	290	-1,463	1,174	371	515
POSCO 홀딩스	291,500	0.69	31.3	55.1	18,530	201	-0.22%	189	-343	139	282	-143
삼성 SDI	612,000	-2.08	68.2	54.7	23,415	-62	-0.08%	-545	-233	782	713	365
일진머티리얼즈	86,700	-1.81	10.1	54.7	101,784	-1,850	0.02%	-233	-125	358	-1,025	1,383
KT	35,500	0.85	13.8	54.1	45,694	-2,590	-0.01%	-2,294	-972	3,269	1,995	1,274

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터