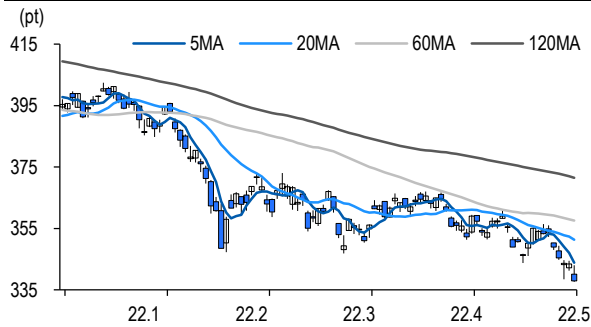


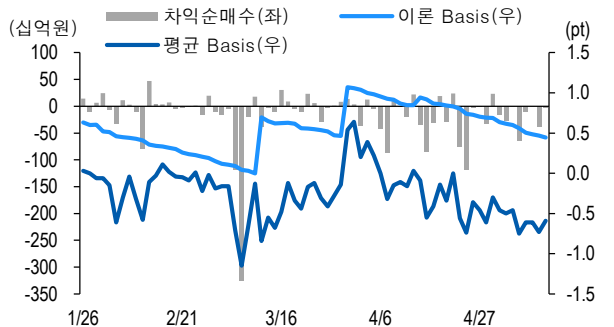
선물옵션시장 지표

2022.5.13

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	337.94	-1.60	-5.50	8,499.5	-
선물 6월물	337.80	-1.53	-5.25	34,137.1	301,655
선물 9월물	337.45	-1.62	-5.55	117.3	13,173
5월물(mini)	338.30	-1.53	-5.26	939.9	0
6월물(mini)	337.74	-1.55	-5.26	1,446.9	41,013

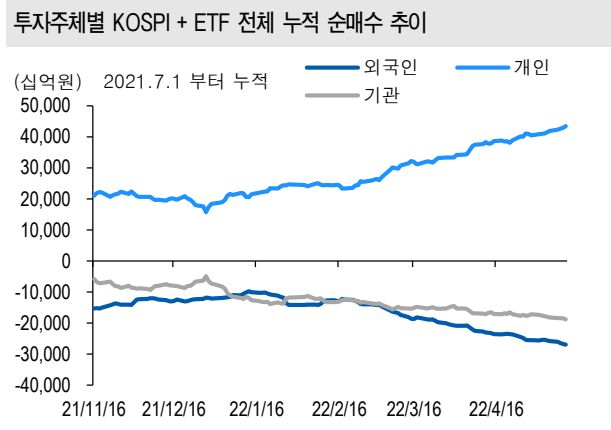


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.45	-0.59	-0.14	-0.31%
베이스스(mini)	0.00	-0.12	0.36	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.45	-0.00	-0.05	-0.13%
합성선물 베이스스(ATM)	0.00	0.37	0.37	0.11%

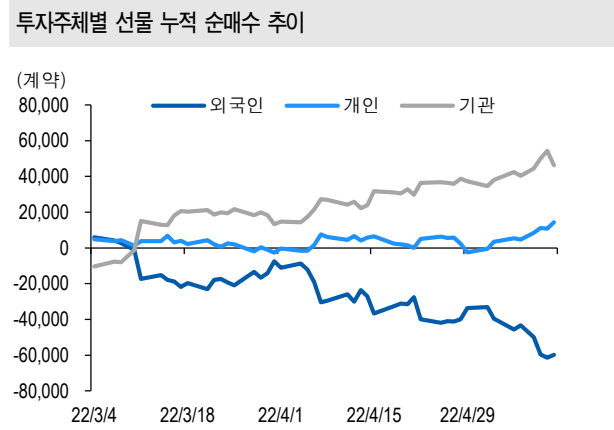


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-280.1	-2.2	-282.3	-0.1	-216.1	225.4	-79.8	0.0	5.9	-34.9
개인	387.2	121.5	508.8	0.0	-1.9	265.9	31.4	-0.6	2.1	1.2
기관	-154.7	-127.0	-281.7	-2.2	92.5	-711.2	34.3	1.0	-6.1	32.4
금융투자	-38.7	-117.4	-156.1	-10.9	108.3	-434.1	44.4	3.5	-6.4	29.3
투신	32.7	-10.9	21.8	0.0	15.5	-235.6	0.5	-2.1	-0.2	-16.9
은행+보험+기타금융	-6.8	0.3	-6.5	0.0	-14.1	-30.3	-10.6	-0.4	0.3	-0.3
연기금+국가지자체	-102.5	2.0	-100.6	8.7	-2.0	-11.1	0.0	0.0	0.2	20.3
기타법인	47.6	7.7	55.3	0.0	-0.8	220.0	14.2	-0.4	-2.0	1.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



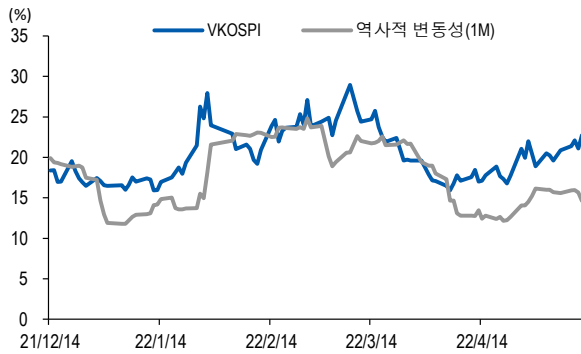
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,432,346	351.3	599,865	12.9%	지수옵션 전체	5,227,329	827.6	1,550,934
Put	2,794,983	476.3	951,069	5.7%	PCR(금액기준)	1.36	VKOSPI	22.72%(+1.62%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	350.0(K+3)	0.01	-0.12	54,013	0	-42,275	26.9	Put	345.0(K+1)	6.68	4.06	53,993	0	-17,083	0.1
	347.5(K+2)	0.01	-0.44	104,128	0	-32,747	22.0		342.5(K+0)	4.21	2.92	336,545	0	-20,541	2.6
	345.0(K+1)	0.01	-1.11	407,097	0	-25,618	16.9		340.0(K-1)	1.74	1.21	807,521	0	-36,685	6.0
	342.5(K+0)	0.02	-2.28	901,076	0	-12,899	12.8		337.5(K-2)	0.12	-0.08	716,007	0	-35,283	4.2
	340.0(K-1)	0.04	-4.04	585,677	0	-7,618	7.7		335.0(K-3)	0.02	-0.06	319,148	0	-45,730	9.1

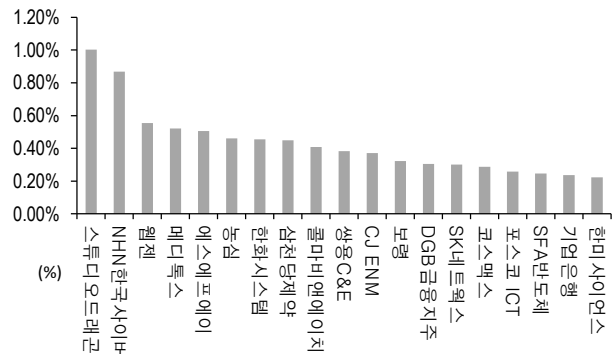
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,769,367	3,351.7	3,948,537	-1,336,987	-5,394	-97,510	101,806	-34.9	1.2	32.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	180,000	-1.64	71.2	56.8	0	-45,963	-0.14%	-2,005	-268	2,273	399	4,440
SK 하이닉스	110,000	-1.35	225.7	50.0	0	-144,765	-0.17%	-5,628	12,425	-6,829	12,182	-14,900
LG 디스플레이	16,950	0.30	19.5	41.6	0	-151,036	0.15%	15,425	-8,833	-6,483	-22,359	-17,661
LG 전자	106,500	-2.29	42.5	33.4	0	-28,694	-0.07%	-2,738	-1,364	4,002	1,368	2,830
삼성전자	65,100	-1.06	343.7	32.4	0	-587,286	-0.14%	4,614	-38,888	34,140	-16,319	51,999
하나금융지주	44,700	0.22	12.6	30.7	0	-41,294	0.01%	1,258	857	-2,065	-2,439	-241
삼성 SDI	568,000	-2.24	52.0	29.7	0	-14,934	-0.12%	-365	-814	1,179	591	447
호텔신라	74,700	-1.84	7.2	28.6	0	-9,833	0.02%	1,096	-747	-349	172	-63
일진머티리얼즈	77,400	-4.80	10.7	27.9	0	-41,369	-0.13%	707	-8,843	8,116	7,151	1,139
기아	85,900	0.00	43.7	26.0	0	-43,795	-0.16%	-5,553	-7,116	12,669	9,040	3,191

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터