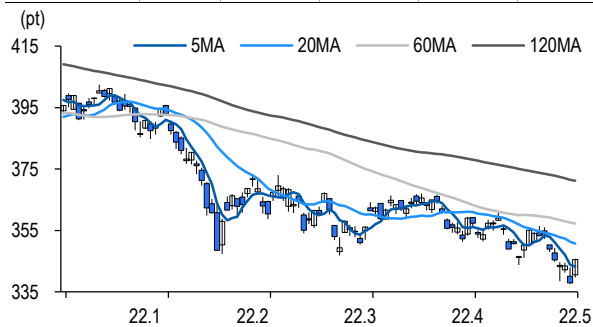


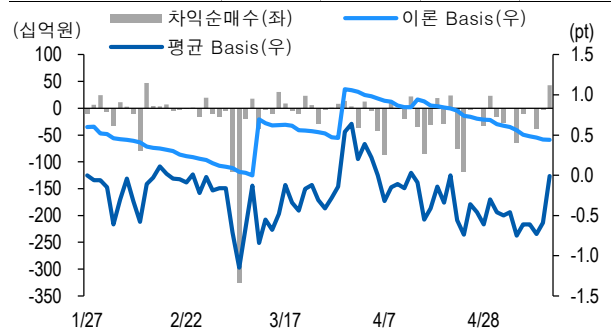
선물옵션시장 지표

2022.5.16

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	345.50	2.24	7.56	6,869.1	-
선물 6월물	345.70	2.34	7.90	22,868.2	289,464
선물 9월물	345.55	2.40	8.10	111.1	13,303
6월물(mini)	345.78	2.36	8.04	1,504.3	48,149
7월물(mini)	345.18	2.35	7.94	13.4	4,459



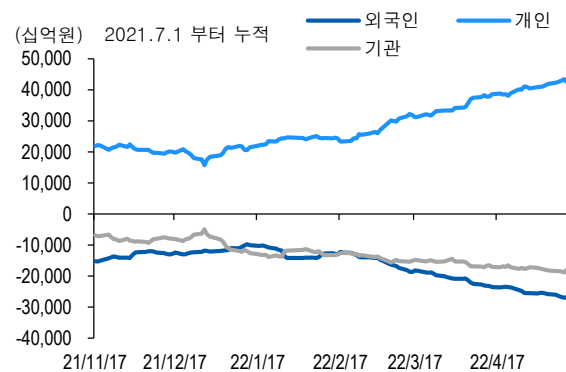
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.44	-0.01	0.20	-0.13%
베이스(mini)	0.44	-0.01	0.28	-0.13%
제1스프레드(SP)	0.47	-0.05	-0.05	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.44	0.31	0.31	-0.04%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	60.0	65.1	125.1	19.7	152.6	958.4	82.8	5.6	-1.4	41.9
개인	-906.9	-6.2	-913.1	0.0	0.6	-676.9	-67.6	-6.9	-3.0	40.0
기관	858.1	-70.2	787.9	23.0	-22.3	-160.2	0.7	2.1	4.3	-83.4
금융투자	631.9	-60.5	571.3	4.2	8.3	-683.9	-0.1	4.1	5.6	61.7
투신	41.4	-8.8	32.6	7.2	10.4	598.2	0.7	-1.0	0.3	-26.6
은행+보험+기타금융	-33.5	-6.2	-39.7	0.0	-20.9	-52.7	0.0	-1.0	-1.5	0.3
연기금+국가지자체	118.6	5.8	124.4	11.7	-15.5	-21.8	0.0	0.0	0.0	-118.8
기타법인	-11.2	11.2	0.1	0.0	0.3	-121.3	-15.8	-0.8	0.0	1.4

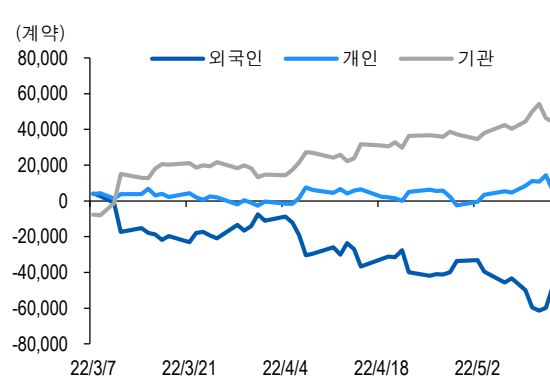
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



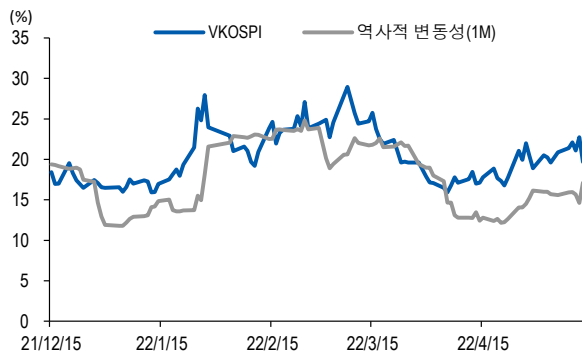
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	703,665	258.2	677,498	17.6%	지수옵션 전체	1,327,469	454.0	1,735,592
Put	623,804	195.8	1,058,094	20.3%	PCR(금액기준)	0.76	VKOSPI	19.69%(-3.03%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	345.0(K+3)	7.14	2.95	11,376	10,180	5,514	17.4	Put	340.0(K+1)	4.61	-4.01	9,467	19,338	2,180	19.0
	342.5(K+2)	8.70	3.46	5,962	2,310	363	18.0		337.5(K+0)	3.89	-3.71	8,652	3,332	1,397	19.5
	340.0(K+1)	10.30	3.81	4,689	6,302	852	18.3		335.0(K-1)	3.27	-3.34	11,452	11,245	1,468	20.0
	337.5(K+0)	12.20	4.45	1,910	1,528	780	19.1		332.5(K-2)	2.77	-2.94	13,310	10,580	2,113	20.6
	335.0(K-1)	13.90	4.71	451	431	10	19.0		330.0(K-3)	2.26	-2.71	25,472	21,456	3,688	20.8

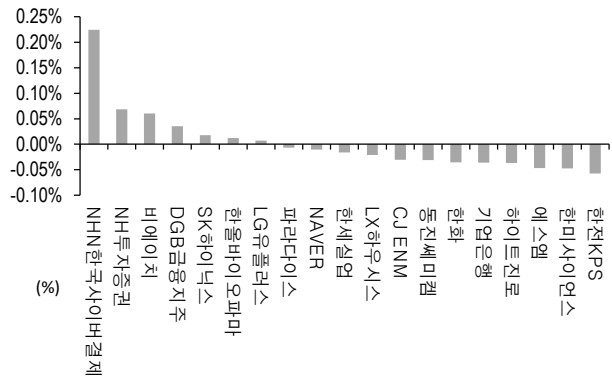
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,266,244	2,365.7	4,179,794	231,257	55,892	49,325	-105,226	41.9	40.0	-83.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	80,200	6.93	22.3	88.8	82,679	-2,877	-0.35%	2,006	-3,687	1,640	1,419	108
삼성전기	160,500	3.22	42.4	75.1	28,972	-346	-0.07%	2,664	1,993	-4,660	-237	-4,423
현대차	186,500	3.32	122.1	71.3	52,151	3,338	-0.18%	-8	377	-434	7,360	-4,789
SK 하이닉스	113,000	3.20	312.7	70.2	190,886	12,964	0.02%	8,923	-2,870	-6,033	-3,754	-8,500
한국금융지주	68,500	3.01	7.3	66.2	18,410	-1,389	-0.11%	1,737	-3,206	1,469	1,442	27
삼성전자	66,400	2.47	617.5	64.4	1,230,621	32,857	-0.21%	16,953	15,462	-32,385	11,585	-53,197
LG 전자	107,500	0.47	47.0	62.3	34,228	9,263	-0.35%	2,870	7,211	-10,086	1,390	-3,768
호텔신라	76,000	1.60	8.6	61.7	10,975	2,068	-0.07%	1,852	124	-1,986	-368	-1,470
GS 건설	39,850	2.44	8.8	61.0	34,503	2,131	-0.12%	-484	805	179	971	-792
넥센타이어	6,480	3.35	1.0	56.9	8,134	163	-0.37%	2,843	-173	-2,670	-1,465	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터