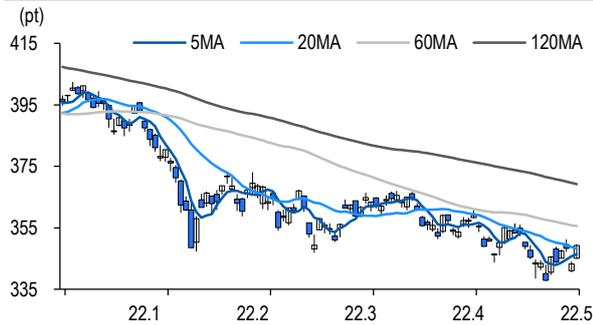


선물옵션시장 지표

2022.5.23

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	349.29	1.76	6.05	6,107.7	-
선물 6월물	349.65	2.21	7.55	21,328.6	296,167
선물 9월물	349.55	2.18	7.45	143.0	14,145
6월물(mini)	349.70	2.22	7.48	1,466.1	61,767
7월물(mini)	348.90	1.87	6.40	7.9	7,902

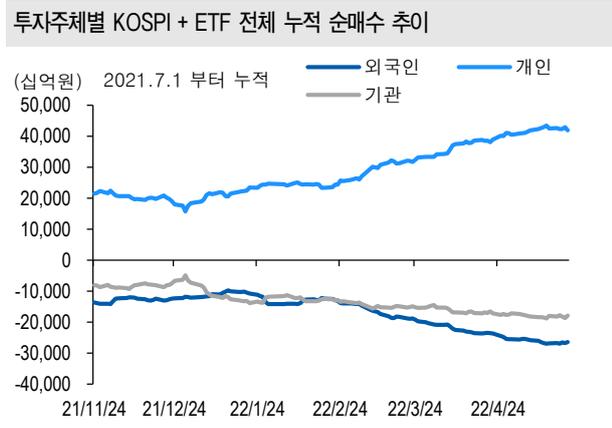


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.33	0.12	0.36	-0.06%
베이스스(mini)	0.33	0.12	0.41	-0.06%
제1스프레드(SP)	0.49	-0.02	-0.05	-0.15%
합성선물 베이스스(ATM)	0.33	0.22	0.22	-0.03%

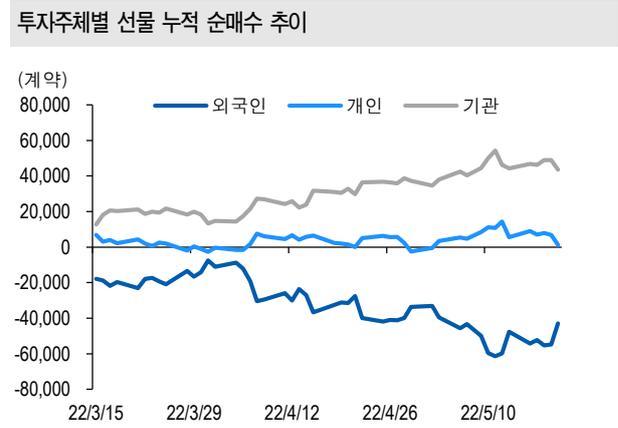


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	194.1	58.7	252.8	10.4	268.5	939.6	84.8	3.7	17.1	2.4
개인	-1,042.7	15.8	-1,026.9	0.0	1.7	-409.4	-79.4	-1.3	-19.2	33.3
기관	836.9	-79.4	757.5	25.2	-16.1	-466.2	1.7	-2.3	2.2	-35.3
금융투자	742.2	-47.7	694.5	6.3	-0.6	-876.1	0.8	-2.4	2.3	-22.2
투신	17.2	2.5	19.7	0.0	-7.3	442.1	0.8	0.1	-0.1	0.1
은행+보험+기타금융	-19.0	-34.0	-53.0	0.0	-4.0	-7.4	0.1	0.0	0.0	0.6
연기금+국가자재	92.8	-5.3	87.5	18.9	6.8	-24.8	0.0	0.0	0.0	-13.7
기타법인	11.7	4.9	16.6	0.0	0.6	-64.0	-7.2	0.0	-0.1	-0.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	937,400	324.6	799,818	16.8%	지수옵션 전체	1,766,804	580.6	2,104,003
Put	829,404	256.1	1,304,185	19.3%	PCR(금액기준)	0.79	VKOSPI	19.10%(-1.32%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	350.0(K+3)	5.44	2.64	27,879	17,482	491	16.8	Put	345.0(K+1)	3.92	-3.68	12,473	12,932	765	17.9
	347.5(K+2)	6.91	3.18	10,882	6,348	-101	17.3		342.5(K+0)	3.19	-3.19	21,054	6,621	1,539	18.5
	345.0(K+1)	8.47	3.66	8,490	12,047	-1,136	17.7		340.0(K-1)	2.58	-2.66	38,433	24,779	5,017	19.0
	342.5(K+0)	10.20	4.15	3,230	3,808	-68	18.1		337.5(K-2)	2.12	-2.22	35,408	10,474	2,855	19.6
	340.0(K-1)	12.10	4.62	1,029	6,494	-119	18.6		335.0(K-3)	1.66	-1.91	46,091	20,166	4,118	19.9

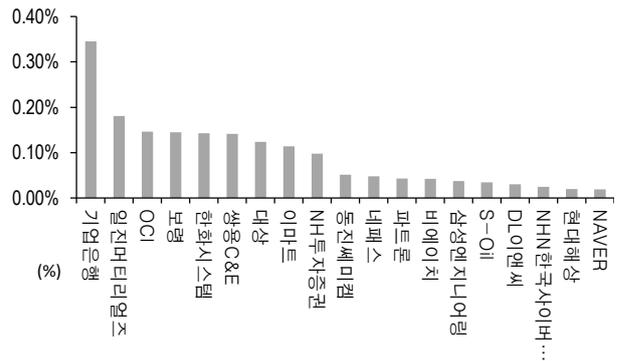
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,783,199	1,986.0	4,593,021	20,127	55,335	21,748	-75,276	2.4	33.3	-35.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	95,100	1.28	36.4	91.7	116,042	12,575	0.18%	-1,689	14,165	-12,494	-9,358	-3,125
SK 하이닉스	112,500	1.35	213.7	80.0	195,317	717	-0.07%	-436	1,342	-876	-686	800
현대차	186,500	2.75	60.0	69.2	51,059	553	-0.10%	1,132	-1,043	-89	1,398	-1,318
삼성전자	68,100	0.89	549.7	67.1	1,267,694	-9,979	-0.07%	-12,333	13,459	1,392	15,401	-8,606
BGF	5,020	1.21	0.3	61.7	7,126	-2,111	-0.61%	-2,580	3,566	-986	-986	0
LG 이노텍	345,500	1.77	29.5	51.6	11,014	-225	-0.04%	908	-434	-474	-194	-305
KT	35,900	-1.10	22.2	51.0	48,251	-12,867	0.01%	17,279	-7,123	-10,130	-7,938	-2,192
GS 건설	38,050	0.93	8.8	49.0	33,607	599	-0.03%	-10	274	-14	-653	639
삼성 SDI	605,000	2.20	79.8	47.3	21,967	1,077	-0.09%	-903	858	-58	-292	-321
신한지주	41,750	2.33	25.0	47.0	86,141	-2,350	-0.03%	2,609	759	-3,368	-1,922	-1,445

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터