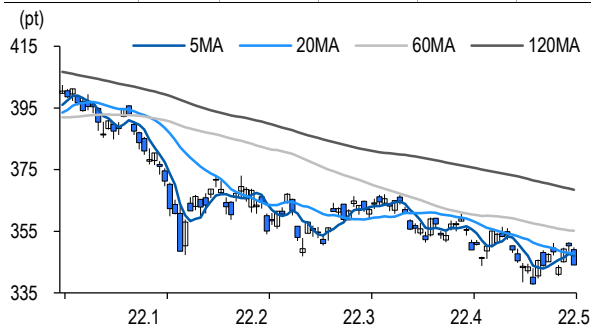


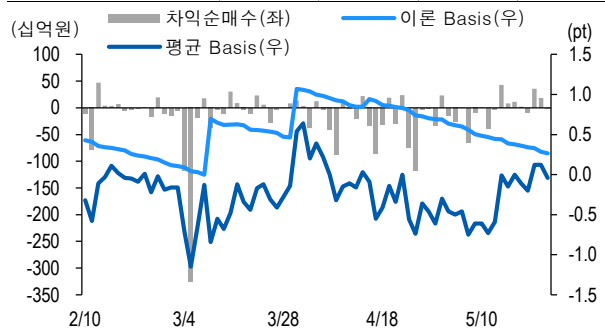
선물옵션시장 지표

2022.5.25

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	344.08	-1.79	-6.26	5,774.3	-
선물 6월물	344.20	-1.85	-6.50	19,191.7	297,601
선물 9월물	344.05	-1.90	-6.65	160.1	14,205
6월물(mini)	344.14	-1.87	-6.52	1,641.3	63,460
7월물(mini)	343.60	-1.77	-6.20	10.4	8,448



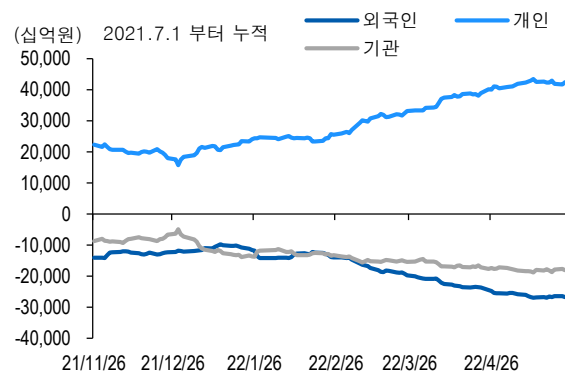
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.26	-0.04	0.12	-0.09%
베이스(mini)	0.26	-0.04	0.06	-0.09%
제1스프레드(SP)	0.47	0.01	0.00	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.26	0.02	0.02	-0.07%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-324.6	12.7	-311.9	0.9	-145.1	-130.0	-91.8	-2.5	3.7	14.1
개인	582.4	40.4	622.8	0.0	-4.2	311.6	83.4	1.0	-4.2	-36.3
기관	-281.3	-42.4	-323.7	-1.7	3.1	-57.8	-0.8	1.5	1.2	25.0
금융투자	-167.4	-58.0	-225.3	3.6	-3.2	578.0	2.4	1.8	-1.0	13.6
투신	-13.9	3.8	-10.1	0.0	6.0	-587.2	-0.5	-0.3	0.0	-30.1
은행+보험+기타금융	-14.4	10.9	-3.4	0.0	-2.1	-38.8	-2.6	0.0	2.2	0.4
연기금+국가자재	-36.5	2.1	-34.4	-5.3	1.9	-9.7	0.0	0.0	0.0	41.2
기타법인	23.5	-10.7	12.8	0.0	-0.1	-123.8	9.2	0.0	-0.7	-2.8

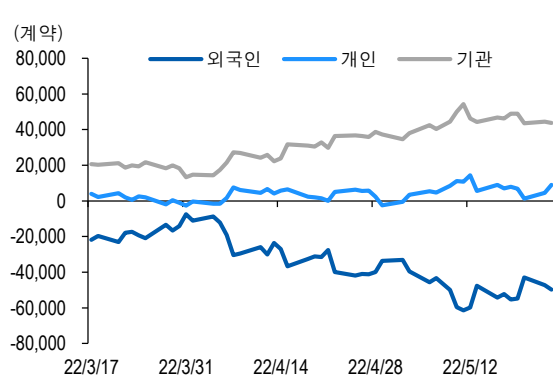
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



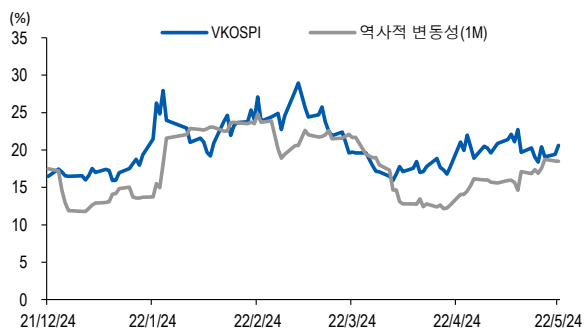
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	672,800	160.7	860,110	16.2%	지수옵션 전체	1,361,393	389.8	2,202,976
Put	688,593	229.0	1,342,866	19.1%	PCR(금액기준)	1.42	VKOSPI	20.61%(+1.17%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	357.5(K+3)	0.85	-1.55	69,265	16,830	2,341	16.0	Put	352.5(K+1)	10.35	3.99	1,461	1,851	-13	17.8
	355.0(K+2)	1.35	-2.01	63,609	25,729	2,841	16.5		350.0(K+0)	8.65	3.48	6,140	15,939	-59	18.0
	352.5(K+1)	1.98	-2.47	27,872	11,238	1,071	16.8		347.5(K-1)	7.15	2.98	6,177	6,153	-62	18.3
	350.0(K+0)	2.75	-3.02	21,952	18,127	750	17.0		345.0(K-2)	5.90	2.50	14,748	13,293	-397	18.8
	347.5(K-1)	3.84	-3.45	7,742	6,816	347	17.7		342.5(K-3)	4.81	2.12	18,558	7,745	1,024	19.3

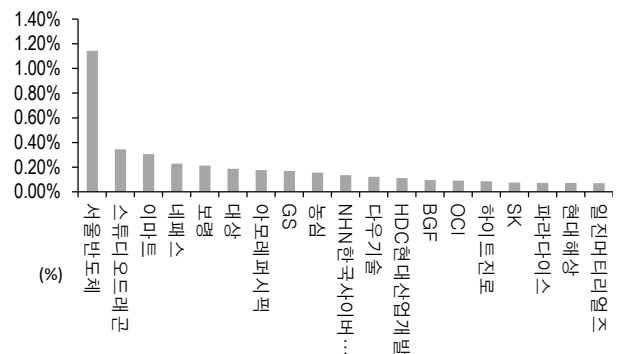
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,401,185	2,354.1	4,589,887	1,287	21,490	-15,384	-4,623	14.1	-36.3	25.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	66,400	-2.35	880.8	85.2	1,206,437	-49,346	-0.08%	36,544	-32,544	-4,167	8,783	11,601
현대차	184,500	-1.86	67.4	84.5	50,930	-2,755	-0.14%	-273	-1,462	1,812	449	2,251
SK 하이닉스	109,000	-3.54	316.3	64.4	207,062	15,164	0.02%	-14,822	21,803	-5,590	-1,969	-900
아모레퍼시픽	156,500	-0.95	17.9	62.8	11,430	-2,226	0.18%	-394	214	180	-2,605	-433
한국금융지주	69,200	-1.56	4.3	59.7	19,172	-1,140	-0.02%	740	-1,557	817	106	711
삼성 SDI	584,000	-4.58	104.0	55.6	22,086	238	-0.20%	371	-2,753	2,568	3,361	116
일진머티리얼즈	93,900	-1.26	26.7	54.6	113,848	-5,152	0.07%	-1,155	-2,498	3,651	-340	3,988
LG 화학	538,000	-0.92	56.8	52.9	8,859	-177	-0.04%	508	-593	83	83	23
LG 전자	102,500	-2.38	35.7	48.0	47,204	-470	-0.21%	-1,237	-421	1,648	834	1,104
엔씨소프트	445,000	-2.31	15.3	47.5	9,726	-144	0.02%	247	-98	-149	-140	-9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터