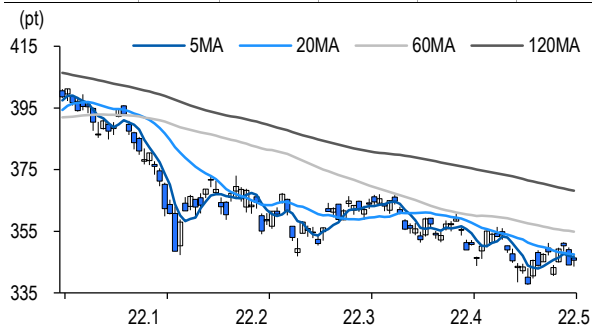


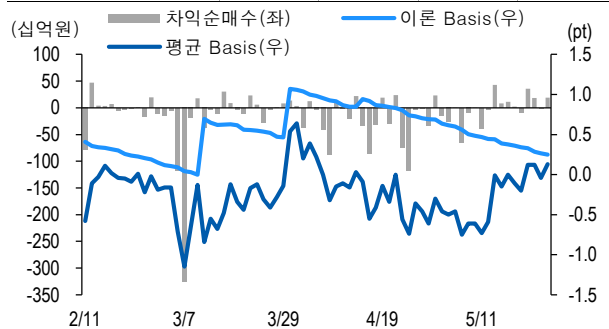
선물옵션시장 지표

2022.5.26

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	345.60	0.44	1.52	5,722.0	-
선물 6월물	346.15	0.57	1.95	20,709.0	296,572
선물 9월물	345.95	0.55	1.90	168.5	15,256
6월물(mini)	346.14	0.56	2.00	1,729.5	62,731
7월물(mini)	345.46	0.54	1.86	12.1	8,578



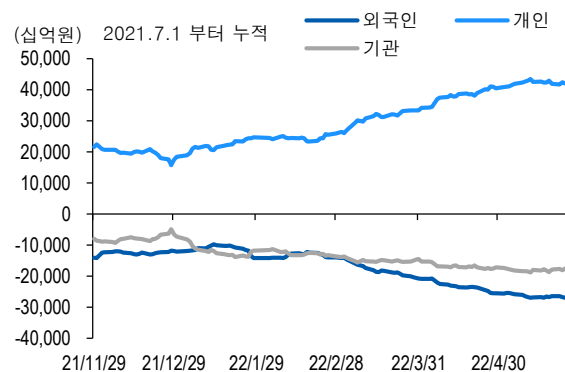
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.25	0.13	0.55	-0.03%
베이스(mini)	0.25	0.13	0.54	-0.03%
제1스프레드(SP)	0.50	0.01	0.05	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.25	0.45	0.45	0.06%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-166.3	24.9	-141.5	3.9	7.3	113.0	95.1	-1.8	0.7	13.4
개인	-357.5	0.2	-357.3	0.0	-4.5	-245.0	-38.9	0.8	0.9	-41.4
기관	511.3	-31.6	479.7	15.2	31.2	-35.5	-54.2	1.7	-1.7	27.6
금융투자	547.5	-13.2	534.2	8.3	28.9	-387.9	-62.7	1.6	-1.5	105.1
투신	-6.7	-2.0	-8.7	0.0	3.3	373.6	5.9	0.0	-0.1	-46.2
은행+보험+기타금융	5.9	24.5	30.4	0.0	5.1	-15.0	2.7	0.1	-0.1	0.1
연기금+국가지자체	33.3	-4.9	28.4	6.9	1.4	-6.2	0.0	0.0	0.0	-31.4
기타법인	12.5	6.5	19.1	0.0	-0.3	167.5	-2.0	-0.7	0.1	0.4

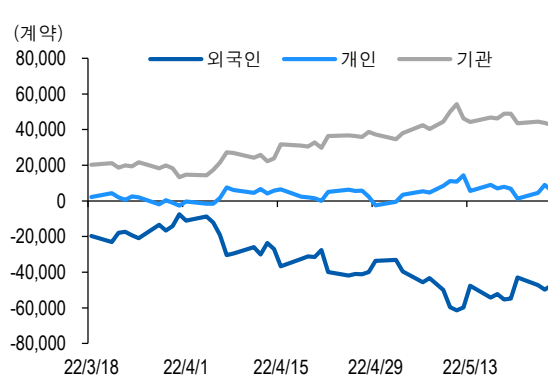
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



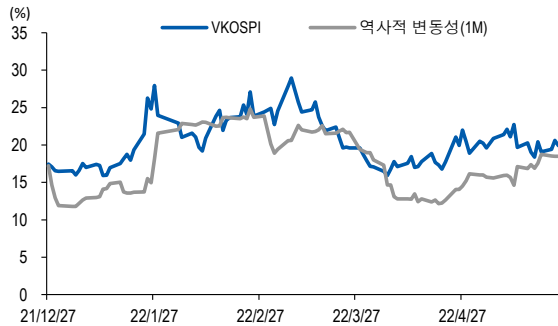
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	771,756	213.3	886,492	16.5%	지수옵션 전체	1,513,572	427.2	2,258,059
Put	741,816	214.0	1,371,567	18.8%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	19.89%(-0.72%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	352.5(K+3)	2.18	0.20	65,659	11,652	414	16.4	Put	347.5(K+1)	5.68	-1.47	5,140	6,068	-85	16.7
	350.0(K+2)	3.17	0.42	36,471	17,861	-266	17.1		345.0(K+0)	4.62	-1.28	12,313	13,792	499	17.5
	347.5(K+1)	4.24	0.40	16,805	7,882	1,066	17.3		342.5(K-1)	3.68	-1.13	17,899	8,020	275	18.1
	345.0(K+0)	5.67	0.61	9,511	13,269	313	18.1		340.0(K-2)	2.88	-0.99	30,589	23,326	633	18.5
	342.5(K-1)	7.25	0.82	2,369	4,101	136	18.8		337.5(K-3)	2.26	-0.86	47,299	12,197	1,661	19.1

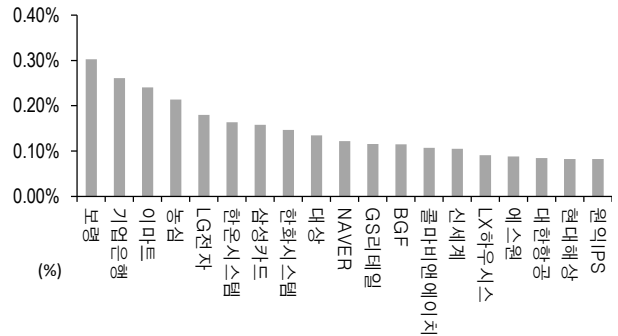
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,310,874	2,495.9	4,515,068	-74,819	7,541	-57,352	48,965	13.4	-41.4	27.6	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	183,500	-0.54	83.0	93.7	49,277	-1,653	-0.01%	640	-2,928	3,088	2,828	260
삼성전자	66,400	0.00	819.4	81.4	1,180,096	-26,341	-0.09%	2,937	-2,839	94	64,974	-9,300
SK하이닉스	108,000	-0.92	355.8	79.5	192,640	-14,422	-0.14%	4,551	1,596	-6,605	7,252	600
기아	82,700	-0.96	48.9	70.5	63,845	2,210	0.01%	3,441	1,570	-5,011	1,687	-5,815
현대위아	63,600	0.47	4.3	66.0	6,327	-332	-0.02%	885	-307	-578	-372	-206
엔씨소프트	445,500	0.11	24.1	61.3	10,317	591	0.02%	-422	719	-309	27	-332
삼성전기	151,500	-0.66	43.9	61.1	38,222	220	-0.09%	1,087	-1,529	418	1,278	-732
일진머티리얼즈	83,300	-11.29	122.5	57.1	94,442	-19,406	-0.22%	-2,928	-19,161	22,055	16,542	5,451
삼성SDI	587,000	0.51	71.2	54.0	20,972	-1,114	-0.10%	509	-915	357	878	-517
현대건설	42,250	0.96	10.7	52.7	14,254	-1,794	-0.04%	-2,140	912	1,284	1,472	-188

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터