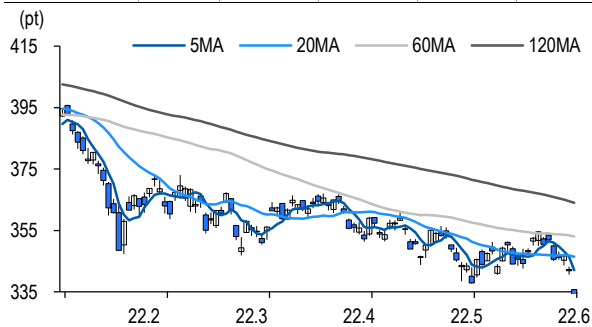


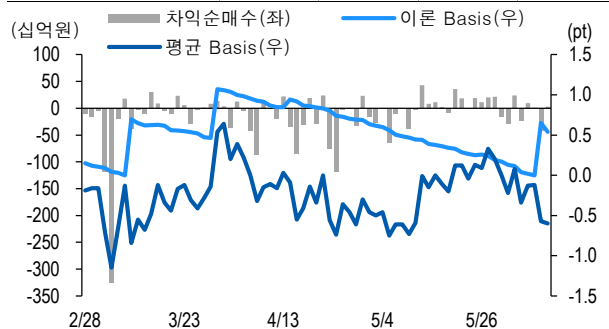
선물옵션시장 지표

2022.6.14

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	329.88	-3.51	-12.01	7,113.2	-
선물 9월물	329.25	-3.47	-11.85	23,356.9	281,454
선물 12월물	330.15	-3.39	-11.60	112.1	16,770
7월물(mini)	329.32	-3.38	-11.52	1,948.5	63,247
8월물(mini)	329.50	-3.40	-11.60	26.3	4,472



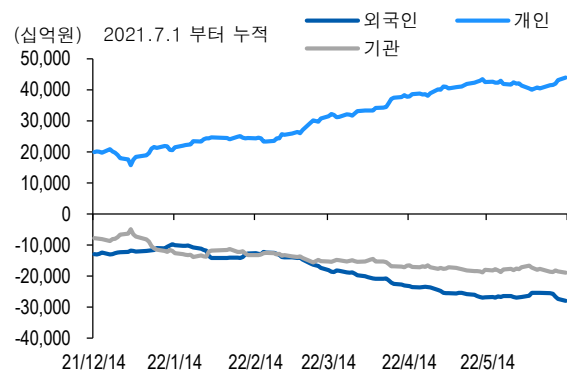
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.54	-0.60	-0.63	-0.35%
베이스(mini)	-0.43	-0.74	-0.56	-0.09%
제1스프레드(SP)	0.90	0.76	0.70	-0.04%
합성선물 베이스(ATM)	-0.43	-0.64	-0.64	-0.06%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-495.6	-66.3	-561.9	-3.0	-285.5	-581.5	-120.1	4.9	-2.1	-3.0
개인	667.6	204.8	872.4	0.0	-10.6	306.6	92.9	-7.5	8.7	-47.4
기관	-217.5	-193.1	-410.6	6.0	13.3	255.2	10.6	2.6	-6.7	53.6
금융투자	-20.0	-282.8	-302.7	-0.4	2.8	657.2	11.5	3.5	-3.9	61.1
투신	-28.7	3.7	-25.0	0.0	-5.9	-358.8	-0.7	-0.7	0.1	-5.9
은행+보험+기타금융	-46.1	16.7	-29.4	-0.1	-9.8	-39.7	-0.2	-0.1	-2.8	-0.2
연기금+국가자재	-20.8	12.7	-8.0	6.5	21.8	-3.5	0.0	0.0	0.0	-1.3
기타법인	45.6	54.6	100.1	0.0	-1.7	19.7	16.7	0.0	0.1	-3.3

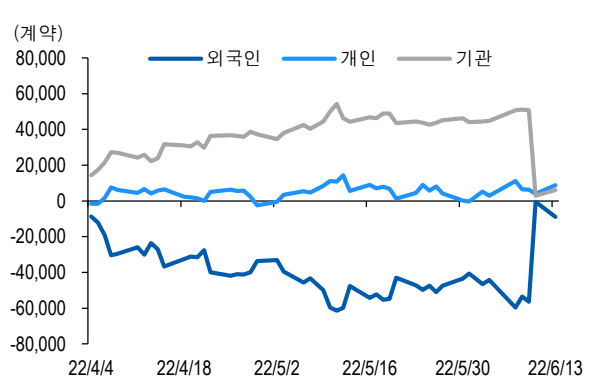
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



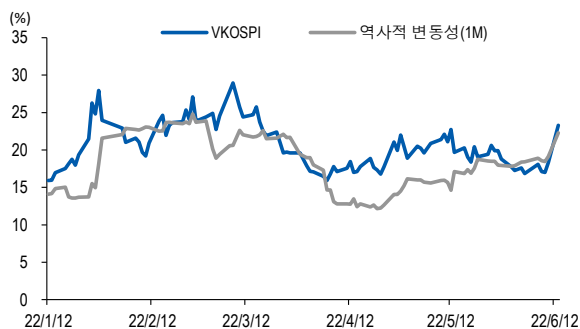
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	677,900	237.5	604,645	18.8%	지수옵션 전체	1,567,500	687.8	1,485,054
Put	889,600	450.3	880,409	20.5%	PCR(금액기준)	1.90	VKOSPI	23.30%(+5.01%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	350.0(K+3)	1.28	-1.90	69,746	14,823	7,243	18.6	Put	345.0(K+1)	18.00	8.90	1,436	5,691	-334	20.1
	347.5(K+2)	1.67	-2.33	65,323	8,632	5,178	18.7		342.5(K+0)	16.00	8.11	1,374	3,208	-102	19.8
	345.0(K+1)	2.20	-2.91	50,297	8,417	4,406	19.0		340.0(K-1)	14.30	7.62	3,095	14,966	-293	20.2
	342.5(K+0)	2.74	-3.54	29,152	4,767	2,454	19.0		337.5(K-2)	12.65	6.98	2,777	2,328	-177	20.4
	340.0(K-1)	3.62	-3.97	22,938	7,423	3,688	19.7		335.0(K-3)	11.20	6.39	6,456	8,626	-128	20.8

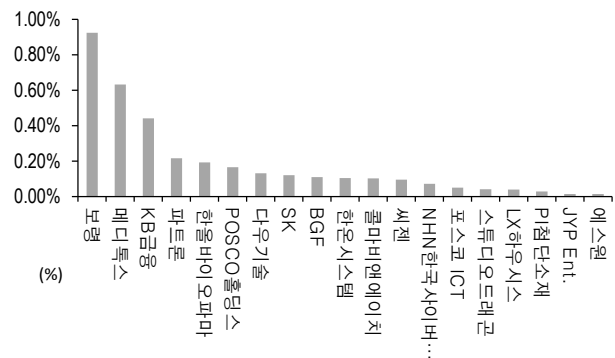
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,420,418	2,323.3	3,611,836	34,572	-25,390	-69,194	100,616	-3.0	-47.4	53.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	78,400	-5.54	20.2	74.2	75,603	-3,006	-0.24%	1,521	-4,026	2,505	1,838	667
LG 이노텍	374,000	-1.45	50.2	73.2	9,096	-255	-0.17%	1,156	295	-1,450	431	-989
현대차	175,000	-4.63	146.4	70.2	38,079	-3,483	-0.20%	-1,728	-3,525	5,203	6,422	-560
한화솔루션	39,500	-2.83	32.6	58.9	29,136	1,661	-0.14%	1,523	2,723	-4,246	-5,736	1,516
영진약품	4,050	-4.71	0.9	58.8	5,408	-2,684	-0.12%	-3,816	1,441	2,375	2,375	0
삼성전자	61,800	-2.98	776.8	56.6	1,104,385	-8,809	-0.03%	-3,557	2,107	3,392	-11,603	2,159
삼성 SDI	548,000	-1.97	61.1	53.4	14,613	-667	-0.07%	-196	-680	880	756	-76
SK 하이닉스	99,000	-4.35	217.0	53.0	199,268	5,464	-0.39%	-9,196	215	8,695	12,169	-1,033
GS 건설	36,050	-5.63	16.1	51.8	28,088	-5,618	-0.10%	1,626	-7,511	5,885	3,138	2,747
웹젠	21,600	-3.79	2.1	50.0	3,298	-2,080	-0.21%	-2,652	4,479	-1,827	-1,801	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터