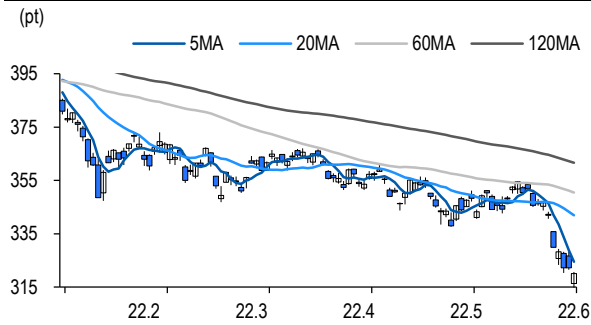


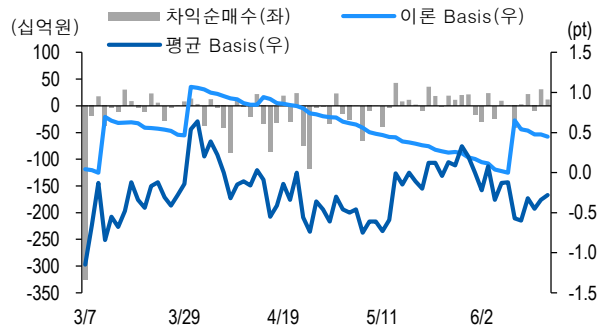
선물옵션시장 지표

2022.6.20

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	320.09	-0.67	-2.16	8,357.7	-
선물 9월물	319.00	-0.81	-2.60	30,353.3	296,574
선물 12월물	319.75	-0.79	-2.55	68.9	17,276
7월물(mini)	318.94	-0.77	-2.48	2,239.2	73,857
8월물(mini)	319.20	-0.80	-2.58	10.2	4,690

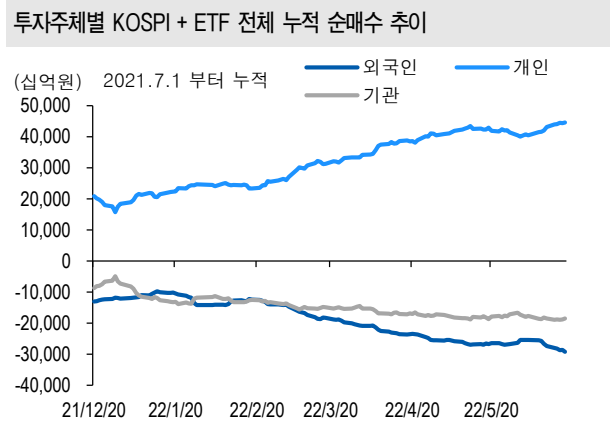


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.45	-0.28	-1.09	-0.23%
베이스스(mini)	-0.51	-0.57	-1.15	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.86	0.74	0.75	-0.04%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.51	-1.14	-1.14	-0.20%

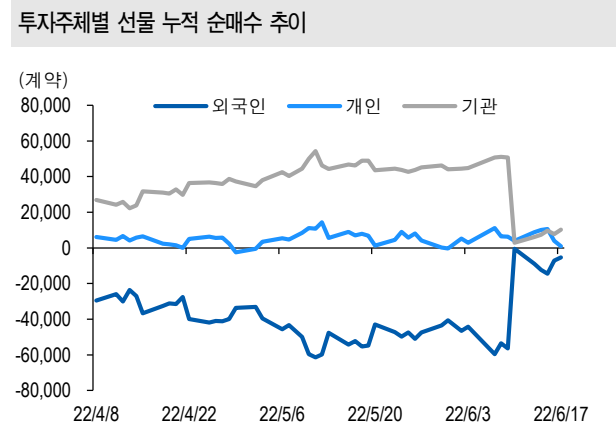


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-692.1	24.3	-667.8	13.8	-443.0	199.2	-58.8	-15.5	4.5	4.8
개인	275.4	28.2	303.6	0.0	-0.3	-198.8	-41.6	14.7	2.4	-13.7
기관	357.7	-85.6	272.1	-1.8	14.9	83.8	111.2	0.7	-7.0	8.7
금융투자	399.9	-100.4	299.5	1.6	13.3	177.3	112.4	2.3	-6.0	-38.4
투신	-14.9	2.9	-12.0	0.0	-22.2	-156.0	-1.1	-0.6	0.6	34.8
은행+보험+기타금융	15.6	17.6	33.2	0.0	21.6	26.8	0.0	-1.0	-1.6	0.0
연기금+국가자차체	-22.7	7.7	-15.0	-9.7	7.0	35.7	0.0	0.0	0.0	12.3
기타법인	59.0	33.1	92.1	0.0	0.7	-84.3	-10.8	0.1	0.1	0.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



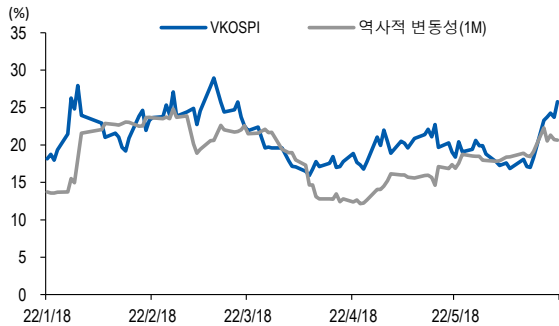
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	917,553	344.1	852,738	21.3%	지수옵션 전체	2,093,244	839.8	1,916,339
Put	1,175,691	495.7	1,063,601	25.0%	PCR(금액기준)	1.44	VKOSPI	25.79%(+2.07%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	330.0(K+3)	3.50	-0.49	60,057	8,486	4,136	21.2	Put	325.0(K+1)	11.40	1.72	2,919	12,620	-399	23.7
	327.5(K+2)	4.34	-0.66	19,069	4,411	1,614	21.4		322.5(K+0)	10.20	1.72	4,802	7,347	262	24.5
	325.0(K+1)	5.39	-0.72	16,993	5,083	2,156	21.9		320.0(K-1)	9.11	1.75	7,875	16,631	774	25.3
	322.5(K+0)	6.65	-0.74	26,321	12,177	10,028	22.6		317.5(K-2)	7.68	1.33	9,598	9,587	466	24.7
	320.0(K-1)	7.84	-0.87	10,464	3,935	2,279	22.8		315.0(K-3)	6.83	1.33	14,570	16,141	953	25.6

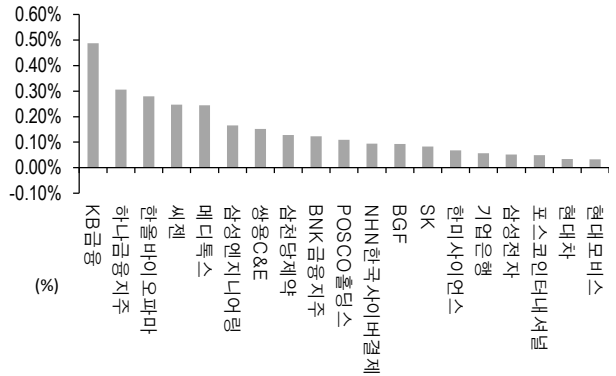
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,146,760	2,692.6	3,840,220	58,369	46,163	-20,502	-25,294	4.8	-13.7	8.7

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넥센타이어	5,800	-3.01	0.9	83.8	5,282	-334	-0.36%	-3,560	313	3,247	3,247	0
GS 건설	34,300	0.29	13.6	79.4	33,844	3,291	-0.05%	986	2,523	-3,509	-2,015	-1,335
현대차	169,500	-1.74	100.2	75.8	40,644	231	0.03%	1,587	457	-2,044	-1,454	20
삼성전자	59,600	-1.49	1,147.3	66.5	1,153,359	8,151	0.05%	-8,795	-25,342	34,138	-14,980	16,400
일진머티리얼즈	79,500	-1.36	26.2	64.2	66,630	-1,815	-0.12%	-2,883	383	2,500	558	1,966
호텔신라	71,300	-0.56	12.0	61.4	15,560	523	-0.06%	-215	77	128	1,540	-1,412
영진약품	3,910	0.77	0.9	61.0	7,095	1,210	-0.15%	3,910	-379	-3,531	-3,531	0
현대건설	40,300	-0.12	10.7	60.8	16,603	750	0.03%	1,711	253	-1,981	-1,032	-949
LG 화학	580,000	-0.34	100.8	60.5	8,222	434	-0.06%	504	-93	-413	-47	-366
LG 이노텍	371,000	0.00	49.3	55.4	8,432	-111	-0.09%	-91	76	15	228	-213

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터