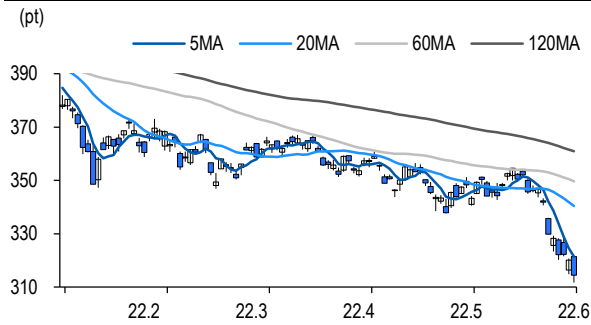


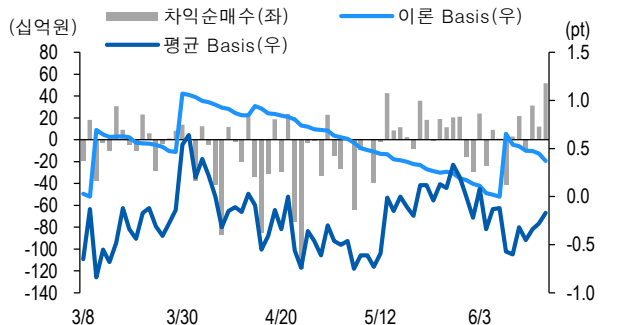
선물옵션시장 지표

2022.6.21

Market Data		(십억원, 계약)			
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	314.44	-1.77	-5.65	6,470.1	-
선물 9월물	313.85	-1.61	-5.15	28,798.6	306,436
선물 12월물	314.65	-1.59	-5.10	72.2	17,334
7월물(mini)	313.50	-1.71	-5.44	2,265.0	82,747
8월물(mini)	313.64	-1.74	-5.56	19.4	4,483

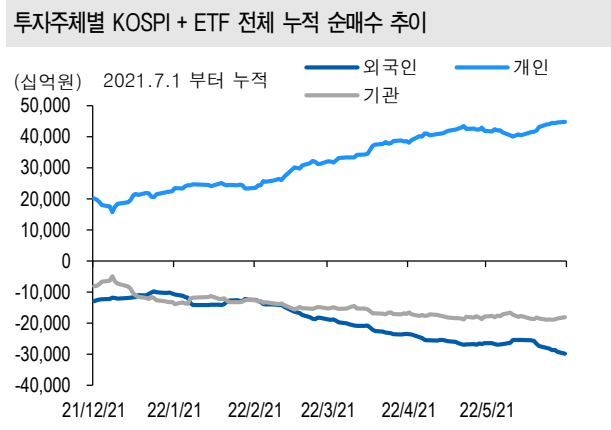


차익거래 관련 Market data		(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)	
K200 베이스스	0.37	-0.17	-0.59	-0.17%	
베이스스(mini)	-0.57	-0.50	-0.94	0.02%	
제1스프레드(SP)	0.85	0.74	0.75	-0.03%	
합성선물 베이스스(ATM)	-0.57	-0.84	-0.84	-0.09%	

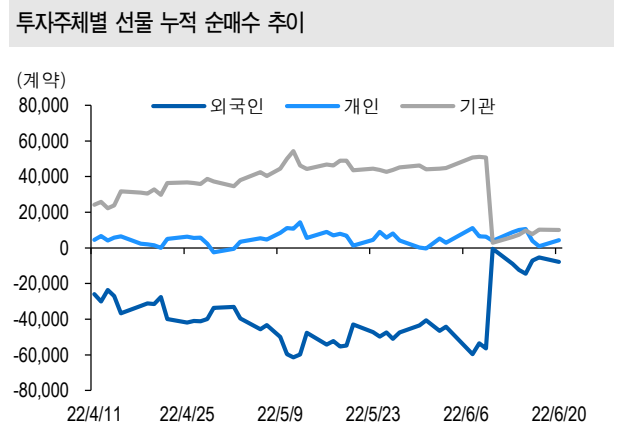


투자주체별 매매 동향		(십억원)								
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-662.8	43.4	-619.5	7.1	-476.6	-59.1	-153.1	11.6	-4.2	7.5
개인	183.3	-23.6	159.7	0.0	5.7	225.2	43.2	-16.2	14.7	-27.2
기관	444.8	-39.1	405.7	44.8	1.0	-114.2	107.6	4.7	-11.7	21.0
금융투자	499.8	0.4	500.2	19.5	20.8	134.3	108.4	4.8	-12.1	44.8
투신	2.0	-9.2	-7.1	0.0	-10.4	-220.8	-0.8	-0.1	0.2	-5.9
은행+보험+기타금융	-17.2	-14.4	-31.6	0.0	-1.9	-6.3	0.0	0.0	0.2	0.0
연기금+국가지자체	-9.2	6.6	-2.6	19.0	0.6	-21.4	0.0	0.0	0.0	-18.0
기타법인	34.7	19.4	54.1	0.0	1.0	-51.9	2.3	-0.2	1.1	-1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



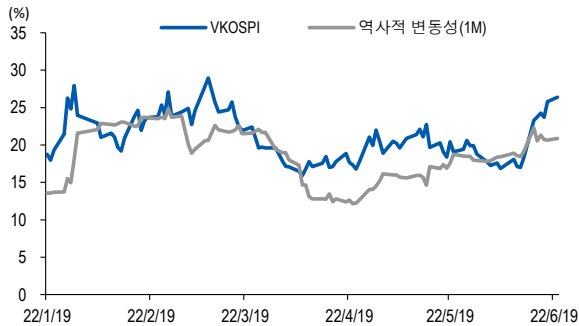
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	902,757	284.6	896,665	22.1%	지수옵션 전체	1,957,856	787.4	1,978,696
Put	1,055,099	502.8	1,082,031	24.8%	PCR(금액기준)	1.77	VKOSPI	26.37%(+0.58%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	327.5(K+3)	2.45	-1.89	41,129	6,668	2,257	21.9	Put	322.5(K+1)	12.75	2.55	1,884	7,057	-290	23.3
	325.0(K+2)	3.20	-2.19	34,678	7,989	2,906	22.4		320.0(K+0)	11.40	2.29	5,800	16,860	229	24.2
	322.5(K+1)	4.01	-2.64	28,363	5,499	-6,678	22.7		317.5(K-1)	10.05	2.37	7,107	9,871	284	24.7
	320.0(K+0)	5.00	-2.84	12,270	5,160	1,225	23.2		315.0(K-2)	8.72	1.89	12,152	16,000	-141	24.9
	317.5(K-1)	6.12	-2.99	6,088	1,955	375	23.6		312.5(K-3)	7.58	1.64	9,537	7,324	-2	25.3

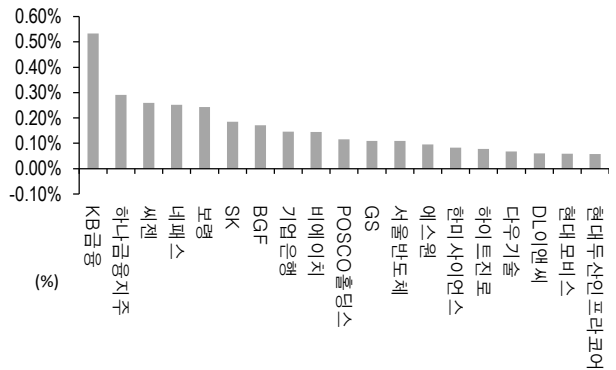
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	5,151,947	3,213.9	3,961,284	121,064	-2,207	-50,323	53,253	7.5	-27.2	21.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	168,500	-0.59	98.2	111.8	42,417	1,773	0.00%	2,588	-586	-2,002	-1,001	-849
삼성전기	138,000	-1.43	88.5	98.8	33,875	-594	-0.20%	4,285	-4,160	-126	-188	747
SK 이노베이션	220,000	-2.87	82.7	96.4	19,301	-1,845	-0.09%	1,740	318	-2,054	1,664	-3,680
넥센타이어	5,560	-4.14	1.1	93.7	3,975	-1,307	-0.20%	1,254	-1,055	-199	-199	0
삼성전자	58,300	-2.18	1,721.4	86.7	1,214,878	61,519	-0.02%	26,031	-29,320	3,874	30,166	-24,632
일진머티리얼즈	77,900	-2.01	21.2	75.8	67,195	565	-0.07%	-63	596	-563	-155	-408
현대건설	38,900	-3.47	11.8	70.6	17,118	515	-0.01%	1,462	424	-1,886	-2,385	499
GS 건설	32,950	-3.94	15.1	68.0	32,931	-913	-0.05%	1,876	-3,751	1,875	2,117	-242
넷마블	69,100	-3.09	8.2	66.8	8,188	1,574	-0.39%	166	-1,000	834	2,507	606
SK 하이닉스	94,400	-1.46	139.3	64.3	196,664	4,419	-0.30%	8,457	-10,870	2,549	2,704	-2,089

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터