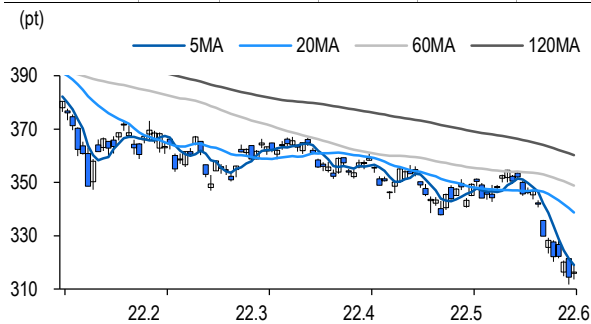


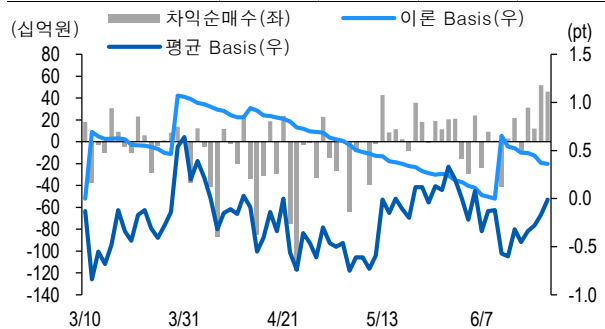
선물옵션시장 지표

2022.6.22

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	316.38	0.62	1.94	5,426.8	-
선물 9월물	316.70	0.91	2.85	26,102.1	308,918
선물 12월물	317.50	0.91	2.85	27.3	17,311
7월물(mini)	316.38	0.92	2.88	2,229.1	86,855
8월물(mini)	316.34	0.86	2.70	24.8	4,429



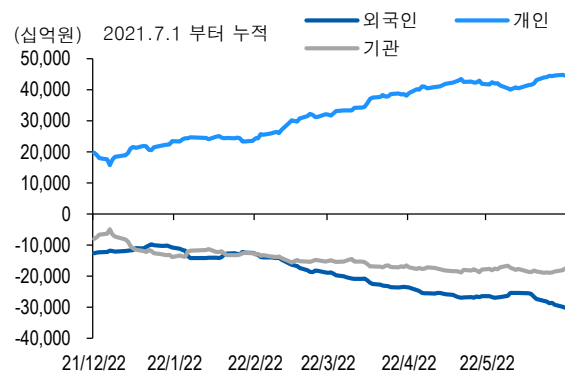
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.36	-0.01	0.32	-0.12%
베이스스(mini)	-0.58	-0.43	0.00	0.05%
제1스프레드(SP)	0.86	0.73	0.75	-0.04%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.58	-0.05	-0.05	0.17%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-319.5	6.1	-313.4	20.8	-205.5	147.3	13.8	2.4	2.2	7.1
개인	-229.7	24.3	-205.3	0.0	2.2	2.3	-12.1	-1.1	2.9	37.3
기관	541.1	-35.9	505.2	25.3	19.2	-157.3	-4.8	-0.6	-5.5	-44.3
금융투자	501.2	-35.0	466.2	23.7	38.1	-629.9	-0.6	1.9	-5.3	-51.1
투신	2.4	-4.3	-2.0	0.0	-12.5	425.1	-4.4	-0.1	-0.1	10.1
은행+보험+기타금융	6.2	4.0	10.2	0.0	5.0	47.4	0.1	-2.4	-0.1	-0.2
연기금+국가지자체	-11.9	1.2	-10.7	1.5	-15.2	0.1	0.0	0.0	0.0	-3.1
기타법인	8.1	5.5	13.6	0.0	0.3	7.7	3.1	-0.6	0.4	-0.2

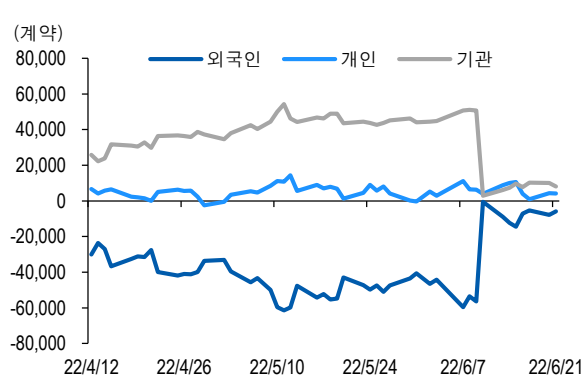
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



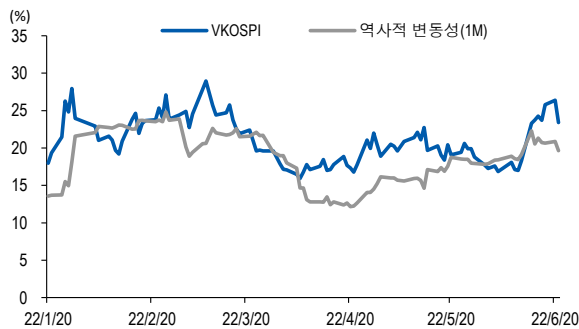
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	811,108	247.1	924,379	21.3%	지수옵션 전체	1,680,112	541.9	2,031,632
Put	869,004	294.8	1,107,253	22.1%	PCR(금액기준)	1.19	VKOSPI	23.40%(-2.97%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	4.07	0.06	11,269	5,835	336	21.1	Put	317.5(K+1)	7.50	-2.55	3,532	9,620	-251	20.5
	320.0(K+2)	5.15	0.15	9,881	5,866	706	21.7		315.0(K+0)	6.39	-2.33	12,912	16,436	436	21.1
	317.5(K+1)	6.35	0.23	5,344	2,405	450	22.1		312.5(K-1)	5.44	-2.14	6,454	7,082	-242	21.8
	315.0(K+0)	7.72	0.41	6,293	3,137	272	22.6		310.0(K-2)	4.59	-1.99	9,654	17,423	503	22.3
	312.5(K-1)	9.27	0.59	1,941	932	208	23.3		307.5(K-3)	3.85	-1.92	8,168	7,787	-28	22.8

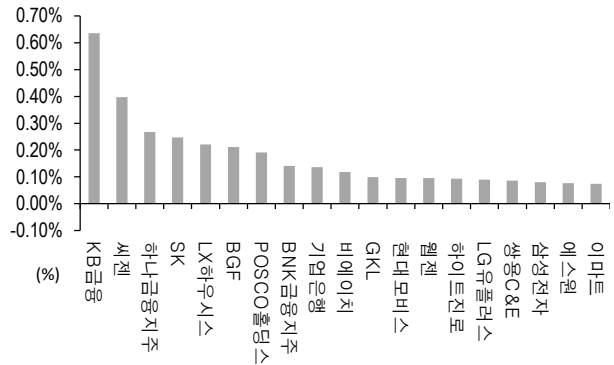
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,442,179	2,765.0	4,115,533	154,249	49,539	74,007	-123,677	7.1	37.3	-44.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	77,000	-1.16	24.6	94.4	67,705	510	-0.05%	-520	1,767	-1,247	-151	-1,120
삼성전자	58,300	0.00	1,366.9	93.3	1,245,893	31,015	0.08%	6,471	30,393	-36,910	-45,367	901
SK 네트워크스	4,250	0.00	1.0	86.3	7,945	953	-0.12%	-851	8	843	843	0
다우기술	17,850	0.28	0.3	84.2	1,022	97	0.01%	152	73	-225	-226	0
삼성전기	138,500	0.36	70.8	82.8	32,783	-1,092	-0.15%	-1,223	847	356	395	-227
현대차	172,000	2.08	72.7	79.5	43,202	785	-0.01%	27	-653	626	414	-481
현대건설	39,350	1.16	11.5	77.3	17,006	-112	-0.09%	2,448	-2,575	119	-126	245
SK 하이닉스	95,000	0.64	188.2	74.5	183,616	-13,048	-0.25%	1,870	20,440	-22,406	-29,311	-1,245
GKL	14,150	1.43	1.4	73.9	11,443	2,279	0.10%	1,562	1,173	-2,735	-2,774	39
호텔신라	71,200	1.42	6.8	72.1	15,202	-281	-0.05%	577	-71	-512	-304	-208

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터