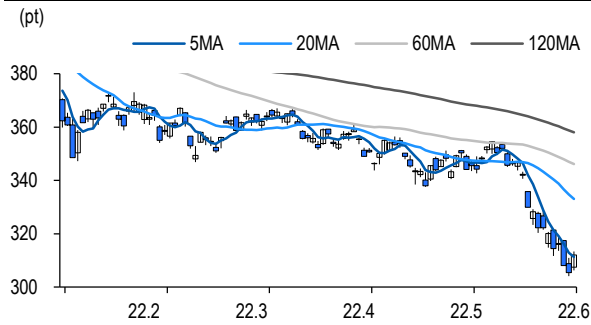


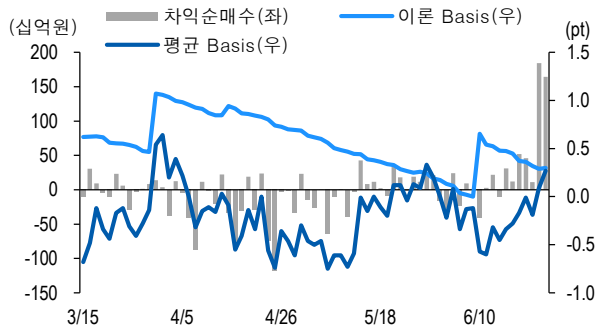
선물옵션시장 지표

2022.6.27

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	312.07	2.17	6.62	6,163.5	-
선물 9월물	312.70	2.16	6.60	29,300.8	314,148
선물 12월물	313.25	2.09	6.40	32.6	17,620
7월물(mini)	311.86	2.08	6.36	2,175.6	103,916
8월물(mini)	312.30	2.13	6.52	11.5	8,718

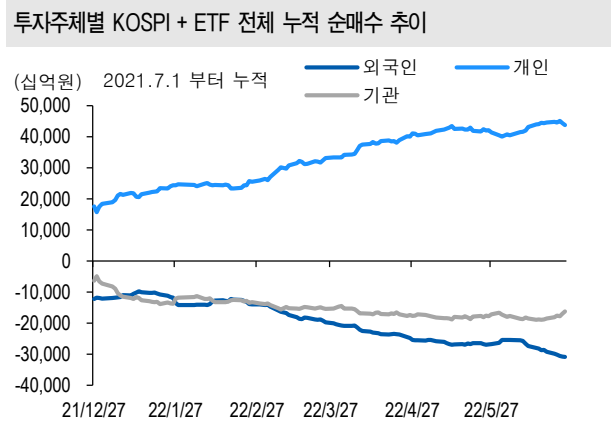


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.30	0.27	0.63	-0.01%
베이스스(mini)	-0.64	-0.46	-0.21	0.06%
제1스프레드(SP)	0.84	0.77	0.80	-0.02%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.64	-0.19	-0.19	0.14%

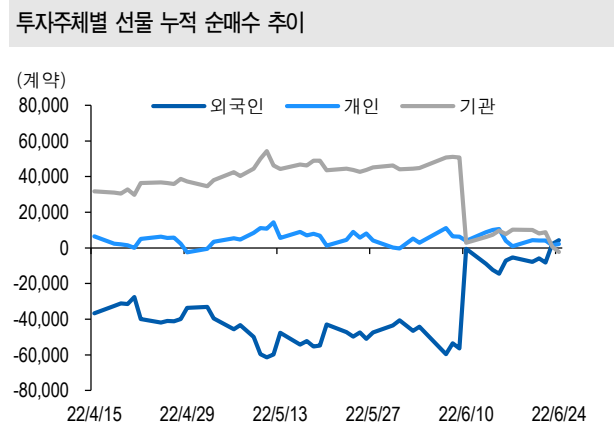


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-35.4	-11.2	-46.6	9.9	31.5	235.1	-77.2	-6.2	2.9	37.5
개인	-625.4	-15.7	-641.2	0.0	-0.5	63.2	-2.6	4.0	8.6	52.5
기관	640.8	30.8	671.6	154.8	34.3	-310.7	81.7	2.3	-11.8	-90.1
금융투자	551.3	18.7	570.0	137.1	37.2	-758.2	70.8	0.2	-8.2	-108.8
투신	8.9	26.0	34.9	0.0	4.0	494.7	2.6	0.0	-0.5	16.1
은행+보험+기타금융	-5.5	-21.0	-26.4	2.3	-1.1	-52.1	8.2	2.2	-3.1	-1.2
연기금+국가자재	16.2	8.6	24.8	-1.7	-7.8	5.0	0.0	0.0	0.0	3.8
기타법인	20.1	-3.9	16.2	0.0	0.2	12.3	-1.8	-0.2	0.3	0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

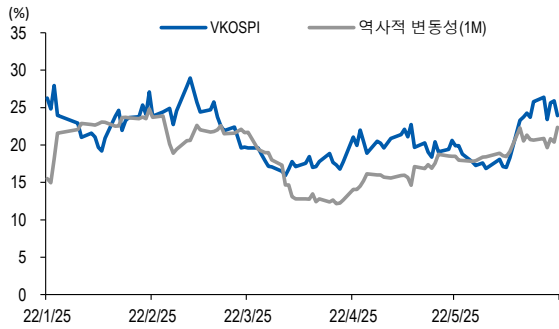
지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,121,728	389.9	1,041,077	22.5%	지수옵션 전체	2,258,792	756.8	2,318,818
Put	1,137,064	366.9	1,277,741	24.0%	PCR(금액기준)	0.94	VKOSPI	23.94%(-1.98%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	312.5(K+3)	6.20	2.31	10,121	3,503	190	22.5	Put	307.5(K+1)	4.82	-3.32	7,318	8,350	43	22.4
	310.0(K+2)	7.63	2.71	9,614	4,528	218	23.1		305.0(K+0)	4.02	-2.93	16,915	13,043	399	23.0
	307.5(K+1)	9.18	3.11	6,110	1,747	45	23.7		302.5(K-1)	3.33	-2.62	17,912	9,298	-649	23.5
	305.0(K+0)	10.90	3.49	2,865	1,756	224	24.5		300.0(K-2)	2.74	-2.29	37,293	25,253	1,587	24.1
	302.5(K-1)	12.35	3.55	1,296	722	253	23.8		297.5(K-3)	2.24	-2.01	35,507	9,320	448	24.6

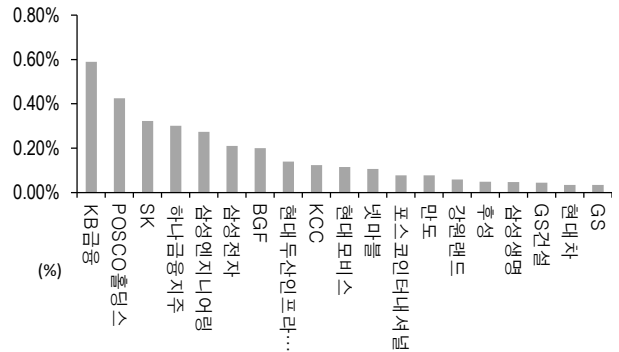
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	4,165,972	2,659.3	4,587,722	73,159	82,570	90,763	-174,235	37.5	52.5	-90.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	58,300	1.92	1,129.9	83.5	1,373,673	44,346	0.21%	39,330	73,020	-112,640	-121,077	6,101
삼성전기	131,000	2.34	64.1	80.4	34,796	-584	-0.03%	448	163	-611	-77	-1,244
현대차	173,000	1.47	63.5	77.8	42,558	61	0.03%	115	1,545	-1,660	-1,870	210
호텔신라	69,000	2.07	7.4	60.0	12,827	55	-0.05%	1,304	-302	-1,008	-894	-114
SK 하이닉스	91,600	1.55	165.4	59.6	228,350	9,181	-0.24%	5,623	10,790	-16,399	-15,574	-800
현대제철	32,950	4.27	12.2	56.2	20,500	-1,094	-0.02%	1,197	-2,361	1,164	1,529	-345
엔씨소프트	435,500	3.94	23.4	53.6	9,551	-689	-0.06%	-501	-226	727	-207	314
현대미포조선	84,000	1.08	8.8	51.7	10,651	-796	-0.05%	-688	836	-168	-156	-12
카카오	71,500	6.56	83.7	51.1	62,705	3,057	-0.04%	1,055	8,723	-9,832	-10,307	-1,104
한국금융지주	61,500	2.33	5.0	50.2	29,533	-358	-0.05%	959	-484	-475	-74	-407

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터