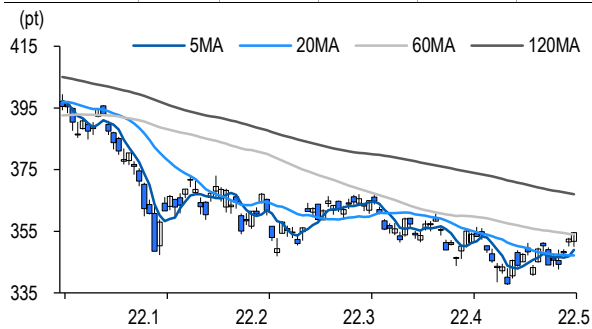


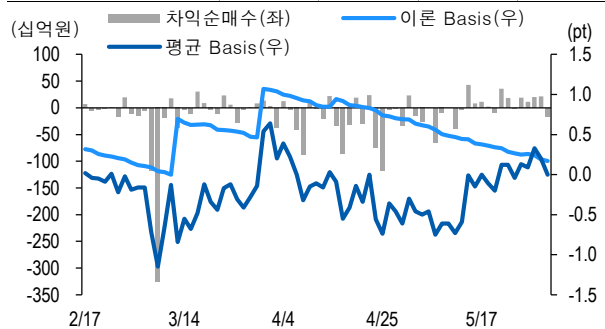
## 선물옵션시장 지표

2022.6.2

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	354.54	0.58	2.05	11,066.5	-
선물 6월물	354.15	0.34	1.20	20,870.5	292,368
선물 9월물	354.40	0.40	1.40	337.1	18,424
6월물(mini)	354.20	0.35	1.40	1,626.6	62,999
7월물(mini)	353.64	0.39	1.36	20.7	10,841



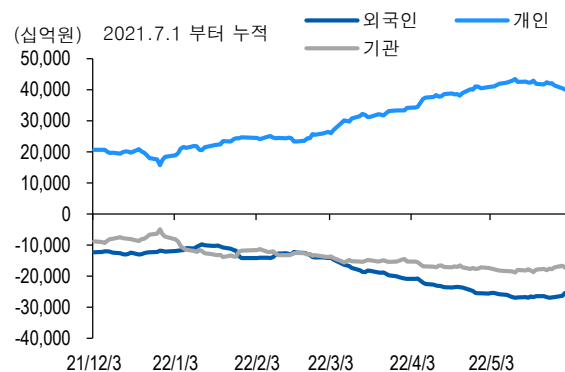
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.17	0.00	-0.39	-0.05%
베이스(mini)	0.17	0.00	-0.34	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.73	0.17	0.15	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	0.17	-0.33	-0.33	-0.14%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	1,058.6	-44.7	1,013.8	-7.7	1,125.7	200.8	51.6	1.0	-0.8	1.2
개인	-509.1	50.3	-458.8	0.0	1.2	4.5	-48.8	0.1	0.1	37.5
기관	-585.2	-16.1	-601.3	-7.9	25.0	-177.7	-2.3	-1.4	1.1	-39.0
금융투자	-572.2	-41.1	-613.2	9.7	8.8	-44.3	-2.0	-1.8	1.2	-70.2
투신	8.2	-3.2	5.0	0.0	-3.0	-190.0	0.1	0.0	0.0	-8.4
은행+보험+기타금융	-14.3	36.0	21.7	0.0	-2.3	40.3	-0.4	0.4	-0.1	0.1
연기금+국가자재	-5.2	-3.8	-9.1	-17.5	31.6	16.2	0.0	0.0	0.0	39.6
기타법인	35.7	10.5	46.2	0.0	-0.2	-27.6	-0.5	0.2	-0.4	0.3

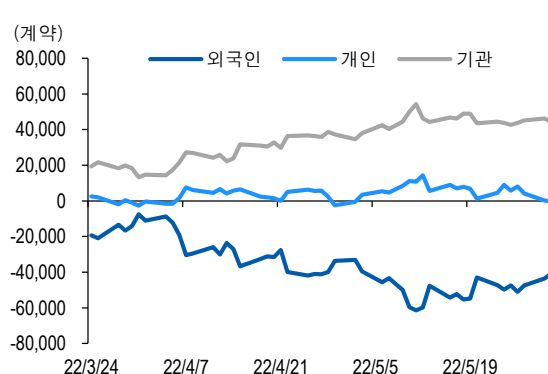
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

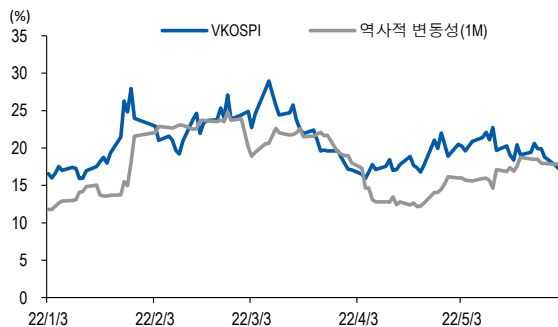
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	828,905	227.1	899,300	12.6%	지수옵션 전체	1,926,445	445.0	2,522,337
Put	1,097,540	217.9	1,623,037	16.4%	PCR(금액기준)	0.96	VKOSPI	17.26%(-0.48%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	360.0(K+3)	1.05	0.19	203,389	54,883	-2,577	12.6	Put	355.0(K+1)	3.74	-1.01	8,831	5,473	989	15.4
	357.5(K+2)	1.82	0.33	132,635	20,273	-740	12.8		352.5(K+0)	2.60	-0.98	27,641	7,730	3,333	15.4
	355.0(K+1)	2.92	0.44	90,318	23,577	-628	13.0		350.0(K-1)	1.75	-0.82	64,192	23,310	2,476	15.6
	352.5(K+0)	4.31	0.55	38,742	14,081	-416	13.1		347.5(K-2)	1.23	-0.60	86,465	12,709	1,395	16.4
	350.0(K-1)	6.05	0.77	11,225	21,010	-581	13.5		345.0(K-3)	0.80	-0.40	100,322	26,663	3,451	16.7

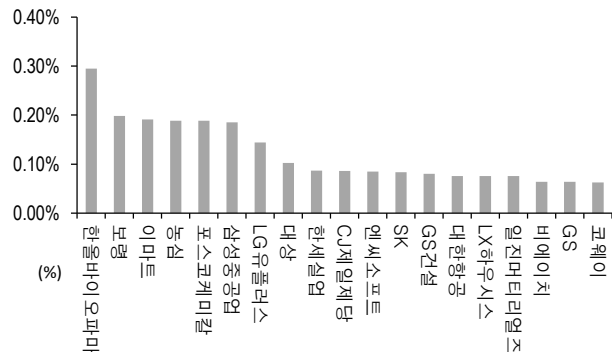
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	3,287,044	2,438.2	4,443,463	69,144	18,553	68,270	-87,923	1.2	37.5	-39.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	67,300	-0.74	955.9	60.6	1,138,627	6,021	0.02%	20,766	21,140	-43,582	-41,101	11,662
넥센타이어	6,270	0.32	0.7	56.4	20,025	4,161	-0.61%	1,458	-24	-1,434	2,566	0
LG 이노텍	383,000	0.79	43.5	51.5	9,682	-424	-0.03%	-139	-315	452	-216	603
일진머티리얼즈	90,000	7.53	62.6	49.3	78,948	5,373	0.08%	1,107	7,060	-8,096	-4,707	-3,389
SK 하이닉스	107,500	0.94	174.3	40.9	167,941	-4,530	-0.19%	2,472	-4,141	1,769	2,755	3,800
한화솔루션	38,850	5.71	75.3	36.7	35,549	8,862	-0.03%	-2,456	3,498	-1,046	-6,163	-1,134
현대차	189,000	0.80	59.3	34.6	46,117	-1,557	-0.08%	-681	-203	879	-1,042	1,921
삼성전기	155,000	0.65	42.9	34.3	34,580	-1,860	0.02%	1,124	1,548	-2,672	-2,220	-451
OCI	129,500	1.17	42.8	33.9	13,098	1,457	0.01%	-147	937	-790	192	-982
와이지엔터	56,700	0.53	2.6	32.8	8,769	667	0.01%	156	254	-510	-504	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터