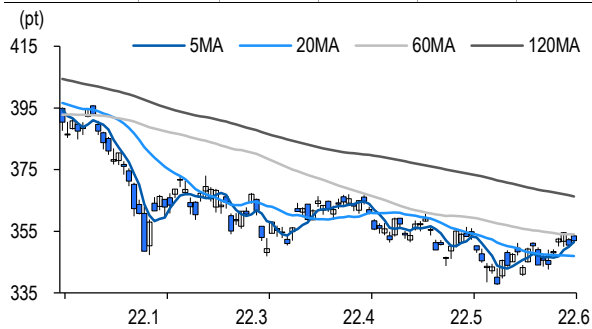


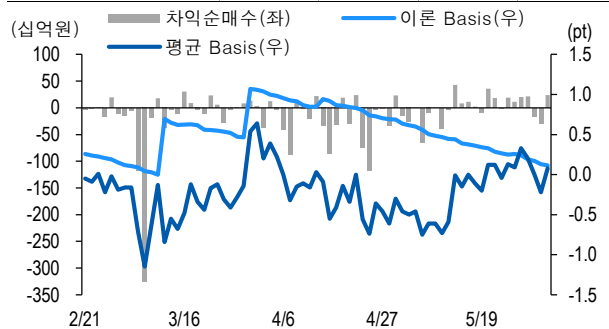
## 선물옵션시장 지표

2022.6.7

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	352.01	0.43	1.50	4,735.1	-
선물 6월물	352.40	0.69	2.40	17,576.6	268,736
선물 9월물	352.40	0.69	2.40	899.7	49,457
6월물(mini)	352.38	0.68	2.30	1,497.8	64,655
7월물(mini)	351.80	0.61	2.12	11.8	15,481



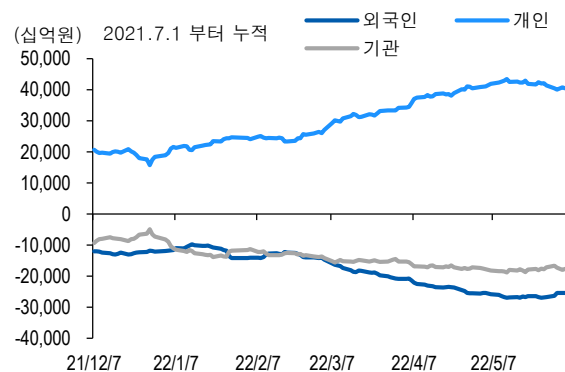
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.11	0.08	0.39	-0.01%
베이스(mini)	0.11	0.08	0.37	-0.01%
제1스프레드(SP)	0.72	0.07	0.05	-0.19%
합성선물 베이스(ATM)	0.11	0.38	0.38	0.08%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-13.0	55.6	42.6	-0.3	-43.0	211.1	-1.0	0.4	-1.0	-5.4
개인	-310.0	-17.2	-327.2	0.0	0.3	-210.7	-4.8	-1.0	-1.1	14.4
기관	322.4	-39.2	283.3	24.4	-23.1	28.8	5.6	0.5	2.0	-8.6
금융투자	213.9	-31.7	182.3	6.7	-13.5	-270.2	7.1	0.5	2.3	-1.3
투신	5.7	9.8	15.4	0.0	6.9	330.0	-1.5	0.0	-0.1	11.9
은행+보험+기타금융	-8.8	-14.1	-22.9	0.0	-14.3	-14.4	0.0	0.0	-0.2	-0.1
연기금+국가지자체	64.3	-0.7	63.6	17.6	-1.0	-16.6	0.0	0.0	0.0	-19.1
기타법인	0.6	0.8	1.4	0.0	0.1	-29.1	0.2	0.1	0.1	-0.3

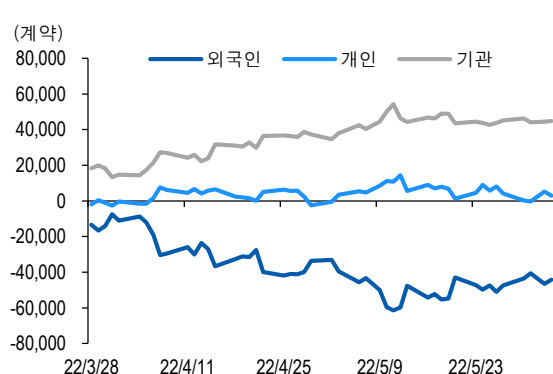
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

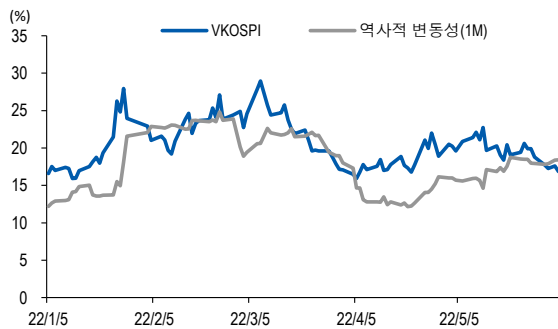
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,071,799	241.0	985,264	12.9%	지수옵션 전체	2,289,119	458.3	2,705,681
Put	1,217,320	217.3	1,720,417	14.3%	PCR(금액기준)	0.90	VKOSPI	16.87%(-0.73%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	357.5(K+3)	0.68	0.18	235,300	26,738	2,323	12.7	Put	352.5(K+1)	2.61	-1.65	55,313	11,412	3,363	12.5
	355.0(K+2)	1.37	0.30	188,865	28,656	-1,081	13.0		350.0(K+0)	1.63	-1.30	127,580	24,653	1,225	13.2
	352.5(K+1)	2.52	0.67	87,471	15,473	-447	13.9		347.5(K-1)	0.97	-0.99	160,983	19,014	4,486	13.8
	350.0(K+0)	4.02	0.95	22,114	22,403	-214	14.5		345.0(K-2)	0.56	-0.70	177,442	31,714	1,732	14.5
	347.5(K-1)	5.90	1.35	7,594	7,446	-206	15.7		342.5(K-3)	0.32	-0.47	137,359	25,574	2,697	15.2

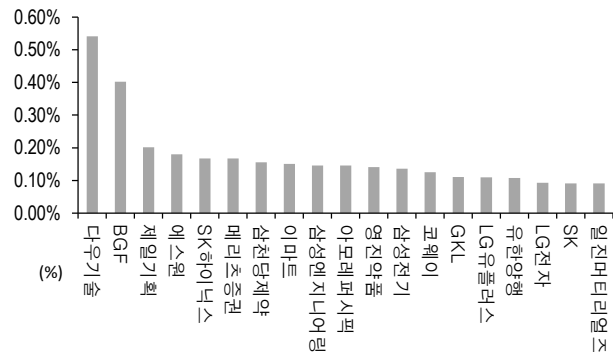
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	2,504,405	1,964.0	4,611,656	144,941	-1,746	26,325	-25,007	-5.4	14.4	-8.6	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	106,500	-0.47	146.2	83.6	149,954	-17,074	0.17%	-8,954	5,630	3,324	394	-900
LG 이노텍	388,500	-0.13	40.9	78.3	8,559	-356	0.00%	186	-302	116	449	-335
삼성전자	67,000	0.45	384.8	70.1	941,797	-120,485	0.03%	-17,722	33,514	-15,936	7,213	-21,400
일진머티리얼즈	87,300	-1.02	21.5	60.4	77,919	-3,143	0.09%	1,135	-383	-752	-1,828	1,076
한국금융지주	71,000	1.43	3.6	57.5	15,275	-3,423	0.03%	-151	-392	569	-72	641
현대차	186,500	-0.53	42.7	57.4	44,799	-805	0.06%	-1,255	77	978	-1,166	-4
하나금융지주	47,650	0.32	13.9	54.8	72,738	-4,861	0.07%	2,674	-62	-2,612	-1,409	-1,273
LG 화학	586,000	2.45	91.7	53.3	8,119	275	0.01%	423	-296	-146	41	-127
POSCO 홀딩스	289,500	0.35	34.0	49.1	11,742	-4,186	0.02%	296	266	-561	-953	392
OCI	132,500	4.33	49.0	49.0	13,901	1,820	-0.10%	3,331	-2,191	-1,155	340	-1,506

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터