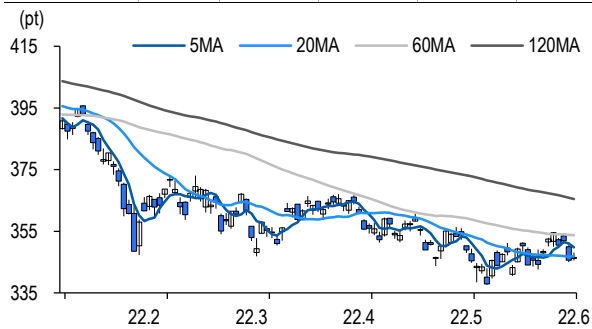


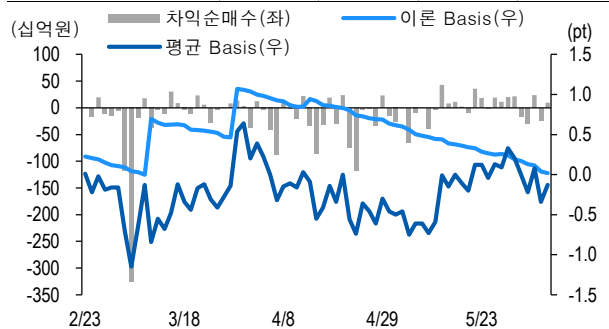
## 선물옵션시장 지표

2022.6.9

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	346.22	0.16	0.55	5,477.9	-
선물 6월물	346.65	0.27	0.95	17,318.6	110,670
선물 9월물	346.40	0.22	0.75	4,908.6	226,591
6월물(mini)	346.66	0.28	1.06	1,362.2	80,527
7월물(mini)	346.04	0.41	1.40	127.7	36,310



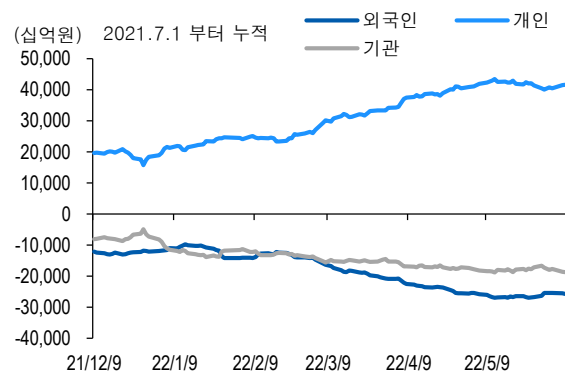
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.02	-0.13	0.43	-0.04%
베이스(mini)	0.02	-0.13	0.44	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.68	-0.18	-0.20	-0.25%
합성선물 베이스(ATM)	0.02	0.37	0.37	0.10%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-105.6	-7.7	-113.3	-1.9	44.7	514.6	27.6	-0.1	-2.8	5.1
개인	139.5	-18.2	121.3	0.0	-1.0	-362.9	-33.9	-0.4	0.9	-17.9
기관	-73.1	27.4	-45.6	11.2	-29.6	22.1	10.5	1.4	2.3	14.1
금융투자	10.6	62.8	73.4	0.7	2.2	-119.5	11.0	-0.1	4.4	16.6
투신	-15.5	-9.3	-24.9	0.0	10.8	228.3	0.3	-0.6	0.0	26.5
은행+보험+기타금융	-19.9	-7.3	-27.1	0.0	-5.8	-69.8	-0.8	2.1	-2.1	-0.6
연기금+국가자재	28.0	-3.3	24.7	10.4	-13.6	-16.9	0.0	0.0	0.0	-28.4
기타법인	39.1	-1.5	37.6	0.0	-0.1	-173.7	-4.2	-0.8	-0.5	-1.3

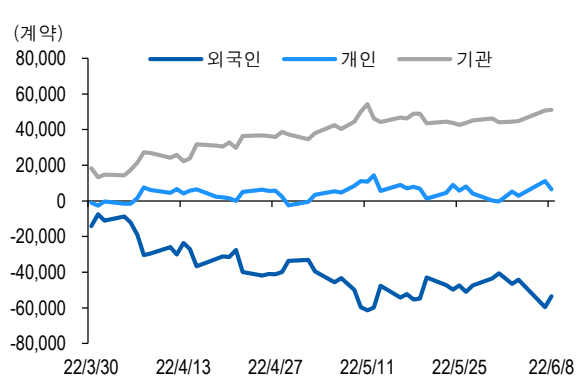
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

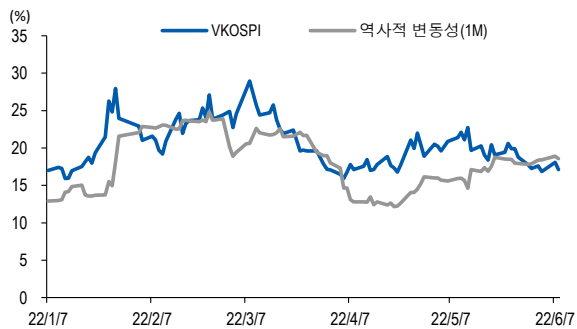
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,574,454	281.1	1,151,425	14.1%	지수옵션 전체	3,282,229	558.4	2,999,907
Put	1,707,775	277.3	1,848,482	13.8%	PCR(금액기준)	0.99	VKOSPI	17.10%(-1.00%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	352.5(K+3)	0.05	-0.13	381,791	49,629	13,662	13.4	Put	347.5(K+1)	1.81	-1.29	136,336	18,762	1,026	10.5
	350.0(K+2)	0.25	-0.25	439,572	46,509	8,602	13.5		345.0(K+0)	0.71	-1.14	334,352	34,846	7,571	12.1
	347.5(K+1)	0.95	-0.17	362,047	23,380	5,463	14.5		342.5(K-1)	0.27	-0.75	376,351	25,220	5,375	14.0
	345.0(K+0)	2.30	-0.10	120,973	21,476	3,593	15.6		340.0(K-2)	0.08	-0.43	328,040	41,331	10,666	15.0
	342.5(K-1)	4.40	0.38	14,864	5,566	630	19.5		337.5(K-3)	0.04	-0.25	174,226	44,707	15,404	17.5

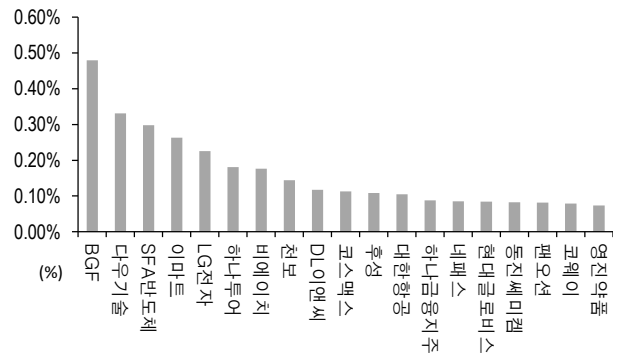
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	2,959,654	2,399.6	4,906,413	74,895	2,525	-7,727	5,960	5.1	-17.9	14.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	106,000	1.92	237.0	74.5	135,853	-15,539	0.06%	4,402	-248	-4,098	-3,408	-7,000
코스맥스	68,700	0.73	2.6	73.1	3,714	-1,371	0.11%	-624	75	553	553	0
삼성전자	65,500	-0.30	565.8	70.7	543,176	-165,486	0.05%	9,797	-9,397	-525	3,747	-29,207
일진머티리얼즈	83,400	-1.18	16.0	66.7	38,492	-16,498	0.04%	954	-892	-60	-230	160
현대차	183,500	0.00	61.0	59.9	38,568	-6,859	-0.03%	-1,490	-164	1,534	1,239	884
GS 건설	37,700	0.00	8.4	55.0	23,846	-4,872	0.04%	603	-391	-212	-322	110
씨젠	42,950	1.42	4.7	54.6	30,900	-23,786	-0.04%	-1,370	356	1,014	1,824	0
LG 화학	579,000	3.58	86.7	53.2	6,323	-1,608	0.03%	673	-1,163	528	572	-23
LG 이노텍	378,000	-3.08	50.3	53.2	5,906	-1,928	0.01%	309	-718	409	515	7
호텔신라	78,600	0.00	6.4	52.9	6,855	-1,499	-0.02%	-942	115	827	399	422

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터