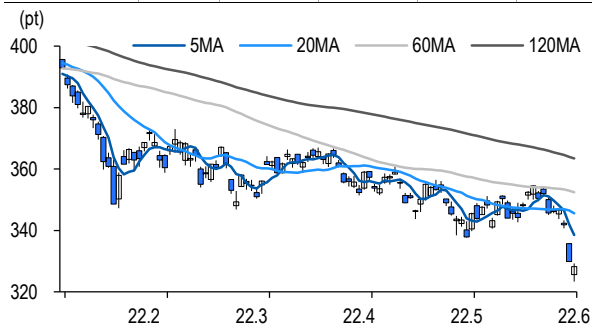


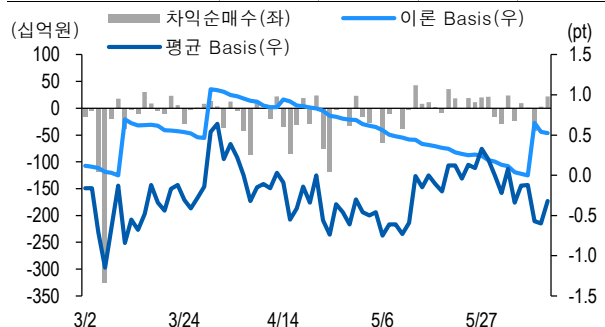
## 선물옵션시장 지표

2022.6.15

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	328.23	-0.50	-1.65	7,328.0	-
선물 9월물	327.00	-0.68	-2.25	30,642.1	288,263
선물 12월물	327.80	-0.71	-2.35	99.7	16,899
7월물(mini)	327.00	-0.70	-2.32	2,424.6	65,642
8월물(mini)	327.62	-0.57	-1.88	19.2	4,566



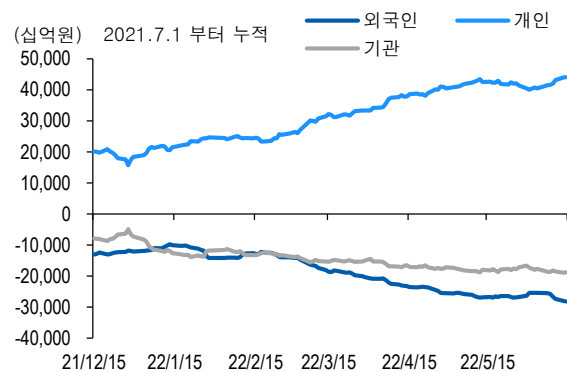
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.52	-0.32	-1.23	-0.26%
베이스(mini)	-0.45	-0.59	-1.23	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.90	0.77	0.70	-0.04%
합성선물 베이스(ATM)	-0.45	-1.23	-1.23	-0.24%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-495.6	-66.3	-561.9	-3.0	-285.5	-581.5	-120.1	4.9	-2.1	-3.0
개인	667.6	204.8	872.4	0.0	-10.6	306.6	92.9	-7.5	8.7	-47.4
기관	-217.5	-193.1	-410.6	6.0	13.3	255.2	10.6	2.6	-6.7	53.6
금융투자	-20.0	-282.8	-302.7	-0.4	2.8	657.2	11.5	3.5	-3.9	61.1
투신	-28.7	3.7	-25.0	0.0	-5.9	-358.8	-0.7	-0.7	0.1	-5.9
은행+보험+기타금융	-46.1	16.7	-29.4	-0.1	-9.8	-39.7	-0.2	-0.1	-2.8	-0.2
연기금+국가지자체	-20.8	12.7	-8.0	6.5	21.8	-3.5	0.0	0.0	0.0	-1.3
기타법인	45.6	54.6	100.1	0.0	-1.7	19.7	16.7	0.0	0.1	-3.3

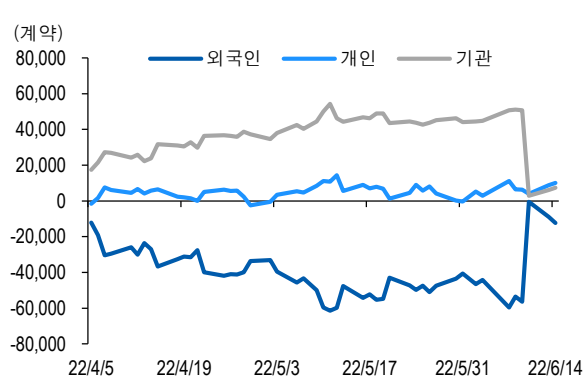
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

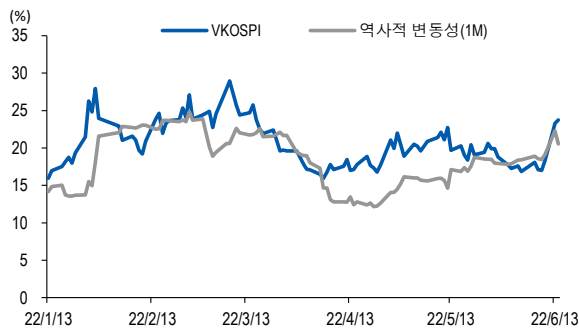
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	993,619	367.5	660,968	19.5%	지수옵션 전체	2,148,136	889.5	1,585,719
Put	1,154,517	522.0	924,751	23.2%	PCR(금액기준)	1.42	VKOSPI	23.74%(+0.44%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	337.5(K+3)	3.60	-0.87	32,891	4,214	2,132	19.3	Put	332.5(K+1)	11.10	1.21	920	4,462	-235	22.3
	335.0(K+2)	4.61	-0.87	19,200	4,706	2,061	19.9		330.0(K+0)	9.76	1.09	4,272	14,411	-207	22.6
	332.5(K+1)	5.48	-1.07	11,424	3,247	1,063	19.8		327.5(K-1)	8.49	0.91	6,369	7,072	-108	22.7
	330.0(K+0)	6.76	-1.16	12,705	2,948	925	20.4		325.0(K-2)	7.41	0.81	12,967	12,852	-1,239	23.1
	327.5(K-1)	7.96	-1.73	5,780	1,638	1,137	20.5		322.5(K-3)	6.48	0.75	13,324	6,402	-394	23.5

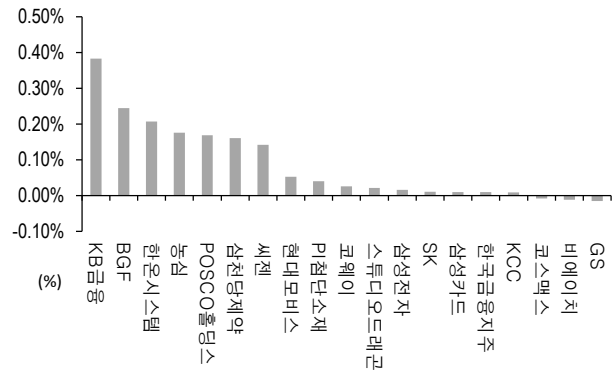
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	4,437,340	2,931.6	3,680,098	68,262	55,762	39,869	-99,111	35.0	34.5	-71.4	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 화학	564,000	0.36	106.0	77.6	8,095	-245	-0.10%	349	97	-446	-216	-211
삼성전기	149,500	1.36	95.1	74.0	33,674	-1,933	-0.16%	-1,027	200	610	2,385	-1,062
삼성전자	61,800	0.00	1,065.6	73.0	1,130,026	25,641	0.02%	1,217	10,136	-11,700	289	-22,784
영진약품	4,000	-1.23	1.2	71.9	4,258	-1,150	-0.08%	-530	78	452	452	0
현대차	170,500	-2.57	134.5	70.6	38,614	535	-0.06%	-534	2,151	-1,717	-196	-2,510
LG 이노텍	375,500	0.40	45.5	68.4	9,245	149	-0.12%	-453	537	-84	5	-89
호텔신라	73,700	-0.67	14.4	67.7	13,016	950	-0.04%	-112	-717	749	1,982	-1,233
GS 건설	35,800	-0.69	19.8	67.1	30,325	2,237	-0.07%	404	2,553	-2,957	-2,796	-161
일진머티리얼즈	78,700	0.38	26.6	66.1	74,092	-1,511	-0.23%	1,797	-3,666	1,911	2,510	-595
SK 하이닉스	98,900	-0.10	196.4	62.4	191,168	-8,100	-0.25%	8,360	7,094	-15,798	-19,280	1,385

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터