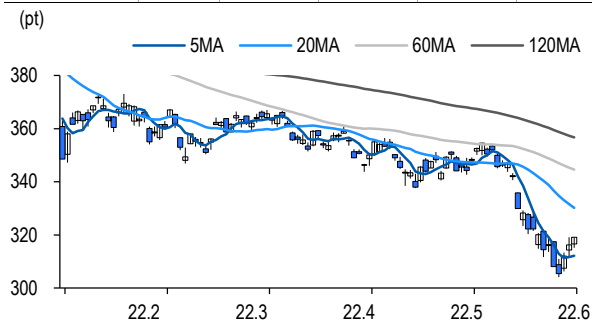


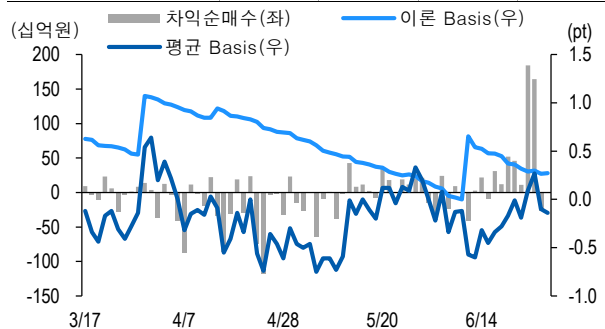
## 선물옵션시장 지표

2022.6.29

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	319.11	0.92	2.91	5,056.1	-
선물 9월물	318.95	0.74	2.35	25,438.6	305,042
선물 12월물	319.70	0.77	2.45	28.4	18,186
7월물(mini)	318.42	0.76	2.40	1,925.5	98,466
8월물(mini)	318.88	0.88	2.78	5.5	10,393



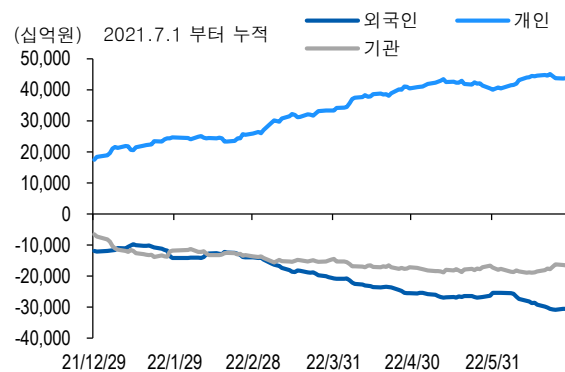
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.27	-0.14	-0.16	-0.13%
베이스(mini)	-0.69	-0.69	-0.69	0.00%
제1스프레드(SP)	0.88	0.77	0.75	-0.03%
합성선물 베이스(ATM)	-0.69	-0.70	-0.70	0.00%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-37.6	12.0	-25.6	-6.9	-77.5	153.5	-2.5	-2.8	9.6	-16.0
개인	106.1	22.3	128.3	0.0	-0.1	-172.3	18.9	3.9	-0.3	-29.6
기관	-88.6	-33.4	-122.1	6.4	-35.5	-16.8	-14.5	-1.0	-8.5	46.9
금융투자	-36.9	-40.1	-77.0	0.0	1.7	59.1	-13.3	-0.8	-6.5	13.7
투신	-2.9	9.9	7.1	-3.1	-14.1	-59.0	-1.2	-0.4	-0.1	-17.1
은행+보험+기타금융	14.4	4.6	19.1	0.0	-3.4	-14.9	0.0	0.1	-2.0	0.0
연기금+국가지자체	-47.6	-1.8	-49.4	9.5	-10.0	-2.0	0.0	0.0	0.0	50.3
기타법인	20.1	-0.9	19.3	0.0	-0.2	35.7	-1.9	0.0	-0.7	-1.3

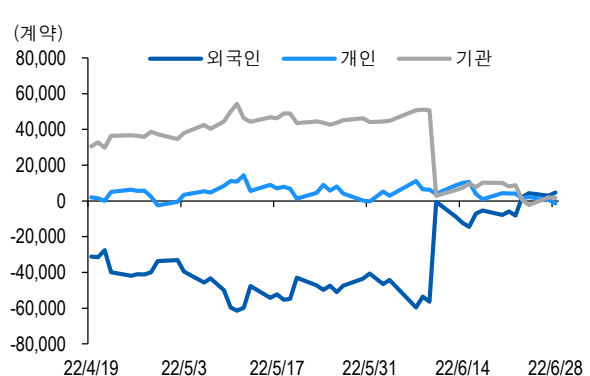
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

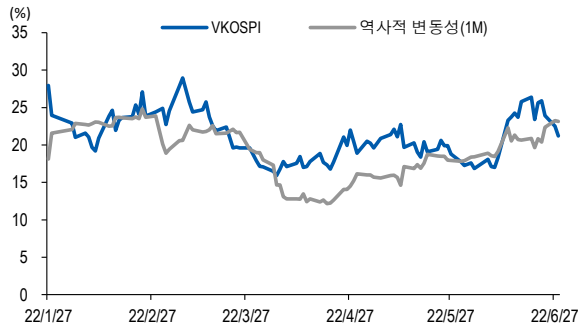
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	844,499	242.7	1,083,161	18.8%	지수옵션 전체	1,829,892	493.4	2,483,937
Put	985,393	250.7	1,400,776	20.8%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	21.21%(-1.29%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	322.5(K+3)	3.41	0.70	45,045	13,645	640	18.8	Put	317.5(K+1)	4.91	-1.67	5,610	10,001	324	19.6
	320.0(K+2)	4.53	0.73	28,077	14,514	92	19.2		315.0(K+0)	3.89	-1.51	21,611	17,981	-257	20.0
	317.5(K+1)	5.83	1.02	11,766	6,645	489	19.5		312.5(K-1)	3.04	-1.36	12,397	7,320	275	20.3
	315.0(K+0)	7.30	1.03	7,947	5,640	-333	19.8		310.0(K-2)	2.38	-1.19	38,095	20,444	1,386	20.8
	312.5(K-1)	8.97	1.36	1,662	3,249	25	20.2		307.5(K-3)	1.83	-1.03	37,476	10,307	607	21.2

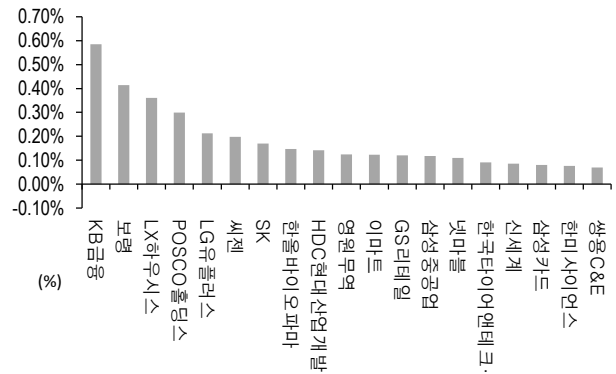
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	3,255,225	2,076.2	4,546,031	-30,114	-45,987	-26,568	73,820	-16.0	-29.6	46.9	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전기	135,500	0.00	59.1	132.7	32,034	-1,185	-0.11%	-2,011	284	1,727	57	1,860
삼성전자	59,000	0.34	736.3	92.8	1,304,159	-41,037	0.04%	7,281	-41,052	34,428	-3,293	44,317
호텔신라	70,600	0.28	8.6	89.4	12,078	34	0.00%	-272	89	133	192	-59
현대차	184,500	1.10	159.3	84.2	47,660	-6,295	-0.03%	1,006	-6,837	5,801	3,182	2,619
BGF	4,180	1.70	0.6	82.3	6,169	-299	-0.12%	-1,084	67	1,017	996	21
현대제철	33,350	0.60	11.0	72.1	21,892	1,460	0.02%	698	704	-1,402	-2,259	857
JW 중외제약	22,450	-0.22	1.1	70.9	2,929	58	-0.05%	51	93	-144	-144	0
넥센타이어	5,500	0.00	0.4	64.2	8,203	-394	-0.24%	-516	-156	672	672	0
한샘	65,500	1.71	2.1	62.1	2,531	135	-0.27%	224	-277	53	53	0
현대건설	39,450	3.14	12.9	61.0	13,511	-1,735	-0.08%	-3,220	-723	3,943	1,687	2,256

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터