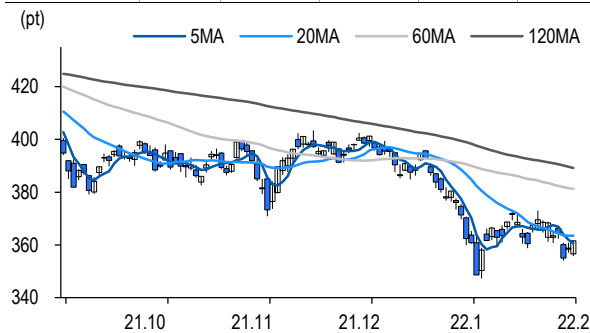


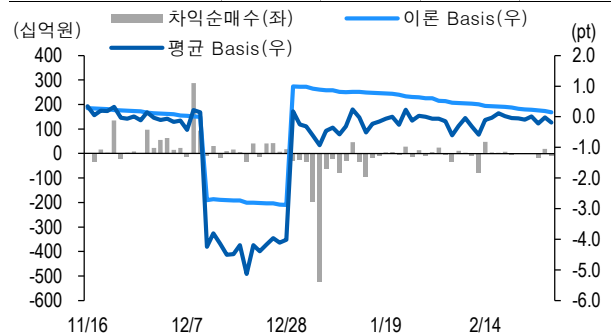
선물옵션시장 지표

2022.3.2

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	361.54	0.86	3.10	9,286.7	-
선물 3월물	361.20	0.50	1.80	25,179.7	279,631
선물 6월물	361.50	0.58	2.10	381.5	18,442
3월물(mini)	361.20	0.50	1.90	2,031.0	51,345
4월물(mini)	361.08	0.61	2.18	19.9	9,067



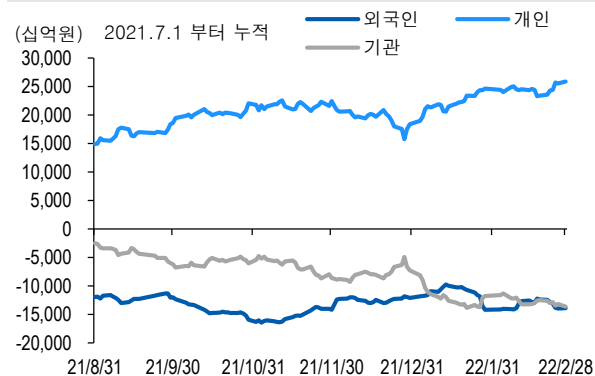
차익거래 관련 Market data	(pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	0.15	-0.19	-0.34	-0.09%	
베이스(mini)	0.15	-0.19	-0.34	-0.09%	
제1스프레드(SP)	0.74	0.22	0.25	-0.14%	
합성선물 베이스(ATM)	0.15	-0.35	-0.35	-0.14%	



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	88.2	-54.5	33.7	0.5	345.5	39.7	-10.7	5.3	-5.0	-9.5
개인	290.8	83.1	373.9	0.0	0.8	-1.8	-19.1	-2.3	0.3	-6.0
기관	-371.6	-35.8	-407.4	-11.5	-33.9	-71.3	34.1	-3.0	5.2	14.9
금융투자	-276.9	-4.1	-281.0	-2.7	-3.1	-215.0	34.9	-2.9	5.2	12.6
투신	-6.2	5.5	-0.7	0.0	-23.8	141.4	-0.6	-0.1	0.0	0.2
은행+보험+기타금융	-27.3	-13.8	-41.2	0.0	-4.0	-10.9	-0.1	0.0	0.0	0.3
연기금+국가자재	-24.2	-0.4	-24.6	-8.7	3.8	13.2	0.0	0.0	0.0	1.7
기타법인	-7.4	7.1	-0.2	0.0	-0.2	33.5	-4.3	0.0	-0.5	0.6

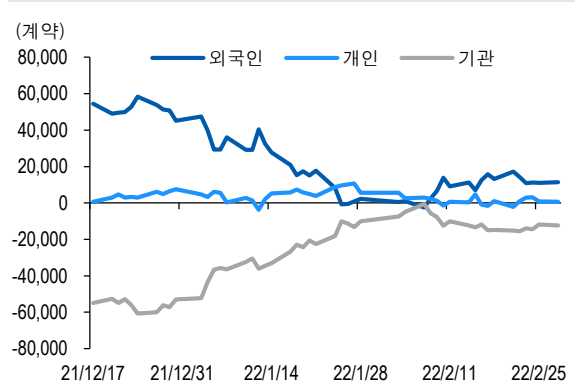
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	968,447	284.7	896,697	21.6%	지수옵션 전체	1,973,767	618.0	2,248,981
Put	1,005,320	333.3	1,352,284	26.6%	PCR(금액기준)	1.17	VKOSPI	24.41%(+0.57%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	365.0(K+3)	3.97	0.56	68,373	11,874	721	21.7	Put	360.0(K+1)	5.38	-1.09	8,436	21,776	-35	24.8
	362.5(K+2)	5.19	0.68	24,833	7,794	1,797	22.3		357.5(K+0)	4.45	-0.90	7,270	10,137	-45	25.4
	360.0(K+1)	6.59	0.74	11,002	8,344	1,049	22.8		355.0(K-1)	3.64	-0.90	13,033	15,210	424	26.0
	357.5(K+0)	8.14	0.82	2,632	3,124	356	23.3		352.5(K-2)	2.95	-0.79	25,863	7,748	405	26.5
	355.0(K-1)	9.81	0.92	1,401	3,541	46	23.6		350.0(K-3)	2.40	-0.82	41,772	24,213	-716	27.1

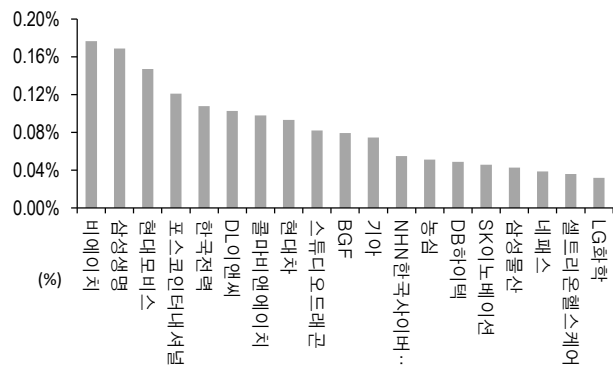
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,863,114	2,428.7	4,857,753	129,646	-13,444	-61,739	75,078	-9.5	-6.0	14.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전기	166,000	0.61	49.7	72.1	26,481	-794	-0.06%	165	-196	39	-1,441	1,479
SK 하이닉스	123,500	0.41	261.5	66.3	181,685	-9,112	-0.02%	3,879	-2,828	-1,090	4,719	-1,900
한국금융지주	78,900	0.51	6.5	63.7	18,713	-94	-0.05%	23	-206	183	-102	285
CJ	84,700	3.42	3.0	60.7	7,389	-19	-0.14%	-140	9	121	111	10
LG 이노텍	327,500	0.00	61.6	59.6	12,777	-2,794	-0.09%	-164	87	79	734	2,203
DGB 금융지주	9,380	2.18	1.8	56.0	12,379	483	-0.08%	1,650	-523	-1,131	-1,131	0
호텔신라	80,400	0.50	11.6	55.3	25,691	-47	-0.10%	406	-248	-158	-371	-58
현대차	175,000	0.29	114.0	54.0	48,805	-1,948	0.09%	-1,975	1,004	971	-93	-705
POSCO	283,000	2.72	52.5	50.9	20,532	86	-0.04%	219	-107	-112	-166	54
GS 건설	43,000	2.75	12.2	50.6	44,197	141	-0.01%	-2,585	5,482	-3,017	-1,588	-1,429

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

