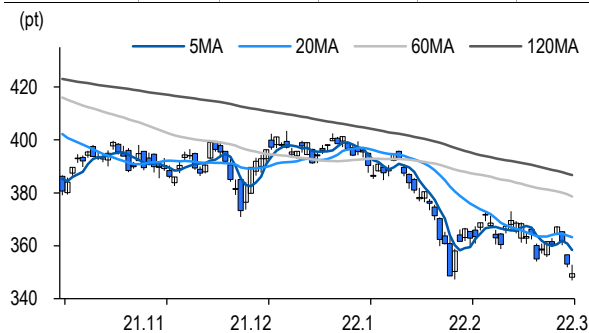


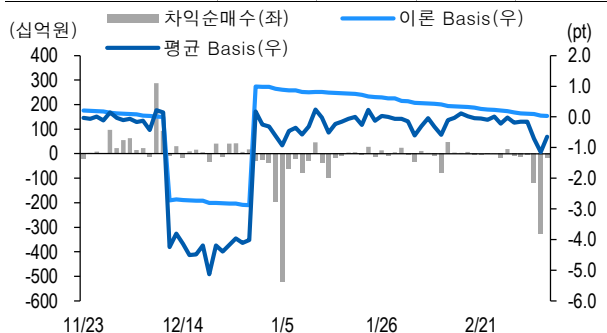
## 선물옵션시장 지표

2022.3.10

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	349.38	-1.03	-3.65	8,471.4	-
선물 3월물	347.90	-1.39	-4.90	23,951.5	126,111
선물 6월물	347.00	-1.56	-5.50	5,548.5	192,377
3월물(mini)	348.00	-1.36	-4.76	1,698.5	61,830
4월물(mini)	347.52	-1.44	-5.06	59.5	16,594



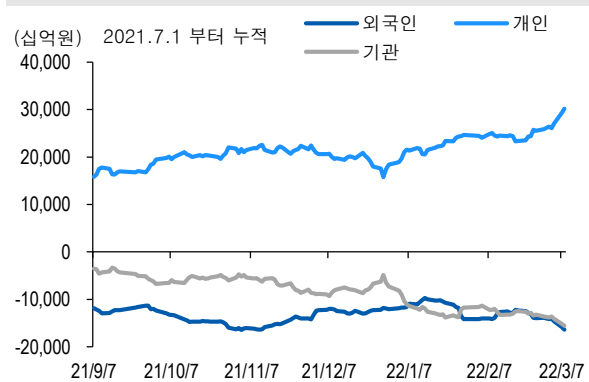
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.03	-0.65	-1.48	-0.19%
베이스(mini)	0.03	-0.65	-1.38	-0.19%
제1스프레드(SP)	0.69	-0.33	-0.55	-0.29%
합성선물 베이스(ATM)	0.03	-1.26	-1.26	-0.37%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-473.9	-15.7	-489.6	4.5	-263.1	-85.7	-28.6	3.5	1.2	37.2
개인	732.8	127.6	860.4	0.0	-9.3	28.4	13.0	-2.6	4.7	-20.5
기관	-292.7	-111.5	-404.2	-23.8	-91.8	-46.3	13.2	0.4	-5.6	-17.4
금융투자	-149.8	-127.9	-277.6	-16.7	-50.6	-54.7	11.9	1.4	-4.3	-26.1
투신	-36.6	12.6	-24.0	-0.9	-18.2	-62.8	-0.3	-0.9	0.2	-0.5
은행+보험+기타금융	8.9	-3.5	5.4	0.0	16.8	67.8	1.6	-0.1	-1.6	-1.3
연기금+국가지자체	-38.9	2.1	-36.7	-6.2	-23.0	3.4	0.0	0.0	0.0	10.4
기타법인	33.8	-0.4	33.4	0.0	-0.1	103.6	2.4	-1.2	-0.3	0.7

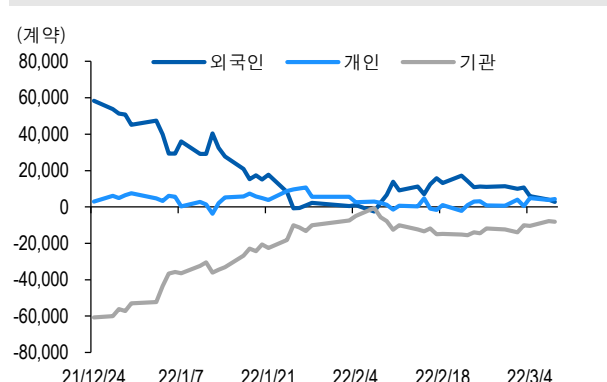
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	1,977,440	409.9	1,200,375	20.2%	지수옵션 전체	3,994,289	988.7	2,756,733
Put	2,016,849	578.8	1,556,358	29.3%	PCR(금액기준)	1.41	VKOSPI	28.95%(+1.11%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	360.0(K+3)	0.13	-0.96	351,607	36,352	14,877	19.9	Put	355.0(K+1)	7.59	2.49	8,068	17,020	-1,144	33.2
	357.5(K+2)	0.31	-1.59	381,410	18,565	9,254	19.9		352.5(K+0)	5.75	1.85	22,533	11,221	-807	31.7
	355.0(K+1)	0.70	-2.26	278,958	19,016	10,848	20.3		350.0(K-1)	4.02	1.07	105,835	22,554	227	29.5
	352.5(K+0)	1.37	-2.89	153,987	11,244	6,679	20.7		347.5(K-2)	2.85	0.65	142,791	13,145	-1,512	29.6
	350.0(K-1)	2.21	-3.59	69,579	7,250	4,066	19.7		345.0(K-3)	1.82	0.21	242,380	26,562	-1,463	28.7

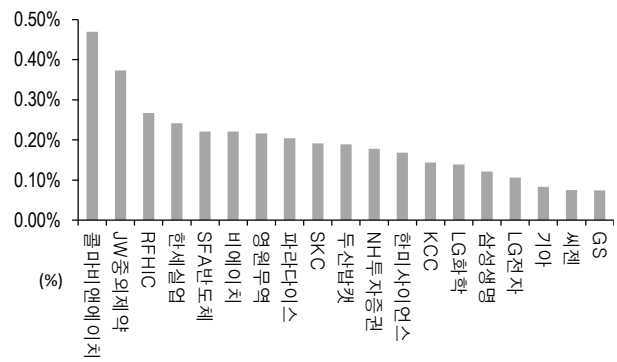
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	4,145,574	3,004.9	5,345,754	80,704	69,536	16,087	-87,242	37.2	-20.5	-17.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	85,000	0.00	18.1	84.0	44,515	-32,592	-0.20%	42	-4,454	4,413	4,605	-192
SK 하이닉스	117,000	-2.50	284.8	68.2	144,286	-23,566	-0.28%	-2,572	-5,247	7,819	9,532	3,370
한국금융지주	76,700	0.66	7.2	65.6	7,713	-6,865	-0.09%	-370	72	388	228	46
아모레퍼시픽	174,000	-2.52	19.1	60.5	11,905	-3,405	0.05%	507	-423	-84	-1,613	-320
삼성전자	69,300	-1.14	595.0	54.3	723,652	-187,586	-0.09%	24,337	-1,346	-23,397	-34,516	8,933
현대차	167,500	0.30	63.8	52.2	37,000	-11,883	0.03%	1,335	-2,390	1,055	-2,365	210
엔씨소프트	430,500	1.77	40.9	51.2	8,501	-2,290	-0.01%	387	-509	122	-186	453
LG 이노텍	345,500	2.07	100.3	51.2	8,111	-1,914	-0.02%	-186	-804	978	842	437
호텔신라	78,900	-2.59	13.4	51.1	17,864	-3,858	0.04%	-1,318	194	1,091	-2,884	400
삼성전기	156,000	0.00	43.2	50.9	24,263	-8,110	-0.24%	2,920	-179	-2,740	66	-471

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터