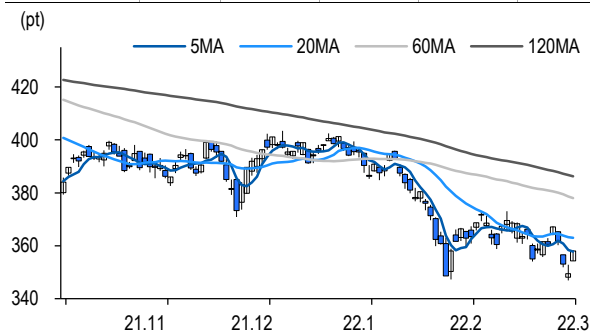


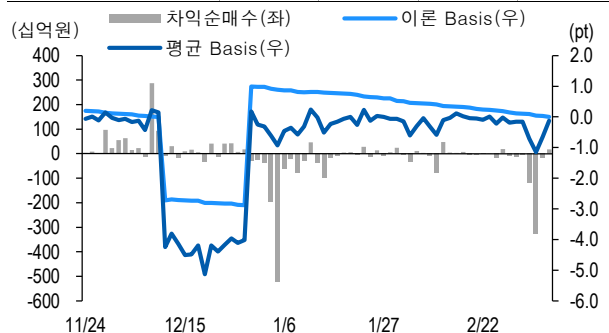
선물옵션시장 지표

2022.3.11

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	358.01	2.47	8.63	10,645.6	-
선물 3월물	355.45	2.17	7.55	12,645.5	0
선물 6월물	356.90	2.85	9.90	11,221.9	235,785
3월물(mini)	355.60	2.21	7.60	746.6	0
4월물(mini)	356.42	2.56	8.90	935.2	19,802



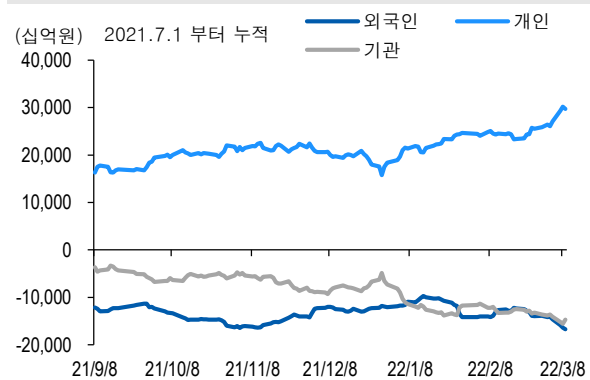
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.00	-0.13	-2.56	-0.04%
베이스(mini)	0.00	-0.11	-2.41	-0.03%
제1스프레드(SP)	0.73	-0.26	-0.05	-0.28%
합성선물 베이스(ATM)	0.00	-2.46	-2.46	-0.69%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-427.2	52.9	-374.3	2.8	-431.4	-524.2	176.5	8.2	1.8	2.4
개인	-352.5	-113.0	-465.5	0.0	7.1	-217.3	-46.6	-3.8	-3.2	-16.5
기관	764.9	75.2	840.1	15.4	242.7	734.6	-127.0	-3.8	2.5	13.9
금융투자	738.8	56.7	795.5	15.3	253.8	204.9	-126.9	-1.5	2.5	89.2
투신	36.2	9.1	45.3	0.0	-37.0	474.2	1.1	-1.9	-0.1	16.2
은행+보험+기타금융	26.5	0.6	27.1	0.0	27.9	1.7	-1.2	-0.3	0.1	0.2
연기금+국가자재	-57.2	-14.6	-71.8	0.1	20.5	53.8	0.0	0.0	0.0	-91.6
기타법인	14.9	-15.2	-0.3	0.0	1.8	6.8	-2.9	-0.6	-1.2	0.1

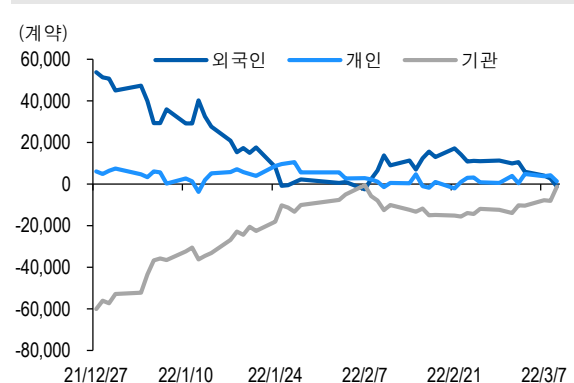
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,927,095	335.2	461,555	4.2%	지수옵션 전체	3,850,738	638.2	1,213,118
Put	1,923,643	303.1	751,563	19.7%	PCR(금액기준)	0.90	VKOSPI	25.71%(-3.24%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	357.5(K+3)	0.02	-0.29	571,594	0	-18,565	3.6	Put	352.5(K+1)	0.01	-5.74	328,457	0	-11,221	13.1
	355.0(K+2)	0.74	0.04	238,833	0	-19,016	2.9		350.0(K+0)	0.01	-4.01	178,666	0	-22,554	18.3
	352.5(K+1)	3.08	1.71	33,227	0	-11,244	0.3		347.5(K-1)	0.01	-2.84	70,557	0	-13,145	23.3
	350.0(K+0)	5.56	3.35	10,048	0	-7,250	15.1		345.0(K-2)	0.01	-1.81	54,766	0	-26,562	28.2
	347.5(K-1)	7.97	4.47	3,838	0	-2,186	0.2		342.5(K-3)	0.01	-1.19	46,243	0	-34,936	33.1

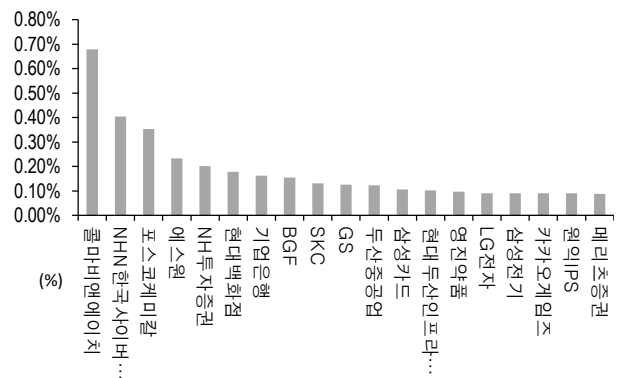
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	5,001,452	3,474.5	3,605,746	-1,740,008	75,322	-62,506	-13,596	2.4	-16.5	13.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	119,500	2.14	275.7	58.7	0	-144,286	-0.25%	3,114	843	-3,955	4,566	-4,256
셀트리온	171,500	1.18	36.9	35.0	0	-20,724	-0.10%	-343	-3,629	3,957	6,224	0
LG 이노텍	349,000	1.01	42.8	31.7	0	-8,111	-0.12%	-1,080	302	784	1,481	-860
현대차	169,000	0.90	49.6	27.3	0	-37,000	-0.04%	-3,251	1,277	1,974	930	1,044
대한항공	27,800	2.96	13.0	23.6	0	-42,803	-0.03%	-1,951	-1,711	3,264	47	-1,228
삼성전기	156,500	0.32	30.9	22.7	0	-24,263	0.09%	-4,511	7,626	-3,114	-967	-5,141
하나금융지주	45,650	2.82	18.9	22.3	0	-67,645	-0.07%	2,319	-11,325	8,941	9,616	-670
엔씨소프트	448,500	4.18	23.5	22.3	0	-8,501	-0.04%	10	378	-385	391	-79
아모레퍼시픽	168,000	-3.45	17.6	22.0	0	-11,905	0.07%	779	119	-905	1,656	445
LG 전자	119,500	1.27	21.1	20.2	0	-25,544	0.09%	291	353	-584	-328	-237

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터