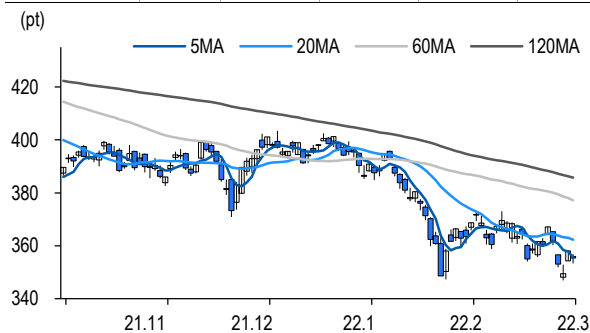


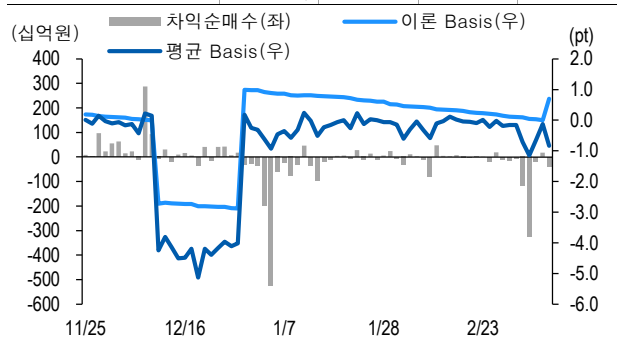
선물옵션시장 지표

2022.3.14

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	355.31	-0.75	-2.70	8,965.8	-
선물 6월물	354.15	-0.77	-2.75	20,737.9	244,632
선물 9월물	354.40	-0.80	-2.85	21.4	5,980
4월물(mini)	354.14	-0.64	-2.28	1,783.4	32,158
5월물(mini)	354.84	-0.38	-1.36	21.1	603



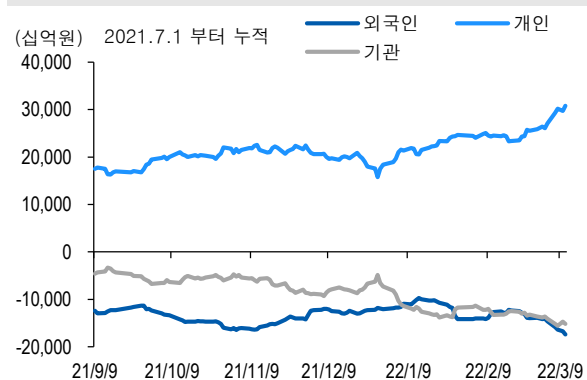
차익거래 관련 Market data (pt)					
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)	
K200 베이스	KOSPI200	355.31	-0.75	-2.70	
베이스(mini)	선물 6월물	354.15	-0.77	-2.75	
제1스프레드(SP)	선물 9월물	354.40	-0.80	-2.85	
합성선물 베이스(ATM)	4월물(mini)	354.14	-0.64	-2.28	



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-682.4	24.6	-657.8	-6.5	-517.2	-255.3	-67.6	-3.6	0.8	10.4
개인	1,038.3	39.6	1,077.9	0.0	10.4	103.2	7.3	1.1	-4.9	54.2
기관	-383.6	-70.3	-453.9	-31.4	-179.3	129.7	61.0	2.7	6.7	-64.9
금융투자	-276.7	-96.8	-373.5	-49.2	-129.4	164.0	60.1	3.1	7.2	-25.4
투신	-3.6	14.2	10.6	0.0	-18.3	-31.3	0.8	-0.2	-0.4	-9.8
은행+보험+기타금융	14.0	-16.0	-2.0	0.0	15.8	-11.0	0.1	-0.1	0.0	0.5
연기금+국가자재	-95.1	5.2	-89.9	17.8	-26.7	8.0	0.0	0.0	0.0	-30.2
기타법인	27.7	6.1	33.8	0.0	1.1	22.5	-0.7	-0.3	-2.6	0.4

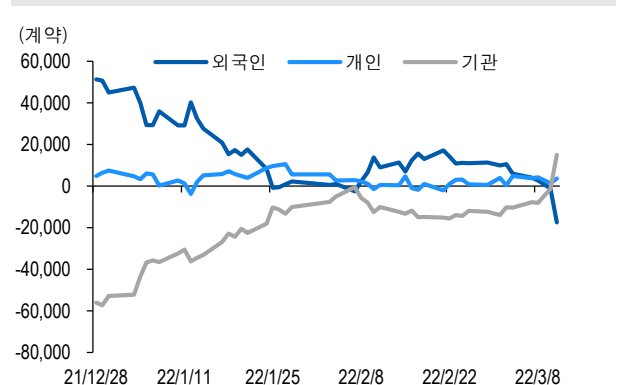
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



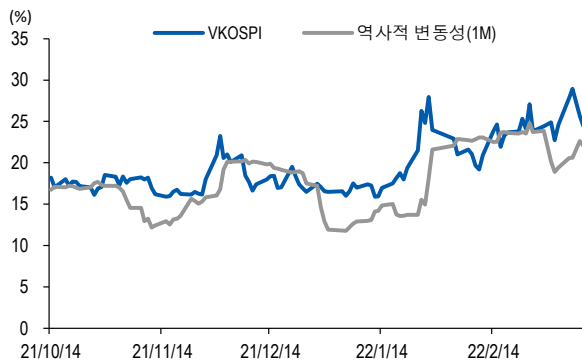
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향										(계약, 십억원)					
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정	
Call	393,248		172.0		513,102		20.0%		지수옵션 전체	1,085,191		491.4		1,340,948	
Put	691,943		319.4		827,846		23.7%		PCR(금액기준)	1.86		VKOSPI		24.41%(−1.30%p)	

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	365.0(K+3)	4.71	−1.28	7,068	4,126	677	19.7	Put	360.0(K+1)	12.55	0.65	442	3,779	61	22.6
	362.5(K+2)	5.67	−1.42	5,505	2,428	478	20.0		357.5(K+0)	11.30	0.75	1,057	1,132	244	23.0
	360.0(K+1)	6.76	−1.53	6,485	3,310	786	20.3		355.0(K−1)	10.10	0.62	4,869	3,797	1,570	23.3
	357.5(K+0)	7.95	−1.71	4,899	2,228	1,019	20.6		352.5(K−2)	9.04	0.45	6,086	2,773	818	23.7
	355.0(K−1)	9.19	−1.91	6,403	2,708	1,413	20.7		350.0(K−3)	8.04	0.30	8,557	7,164	838	24.0

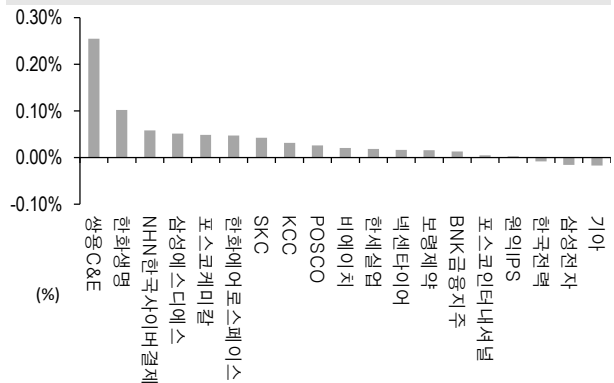
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,940,856	2,610.8	3,991,679	385,933	82,389	61,495	-144,496	10.4	54.2	-64.3		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균피리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	85,200	-0.93	21.3	117.1	108,039	-5,567	-0.25%	1,129	-1,846	696	-3,386	4,082
LG 이노텍	351,000	-0.57	65.4	67.6	10,833	724	-0.06%	569	551	-1,122	-215	-1,047
하나금융지주	46,500	1.75	33.2	62.2	91,359	15,101	-0.02%	-2,009	-4,199	5,908	-4,156	-7,118
아모레 G	46,000	-0.33	3.7	61.2	7,801	2,221	-0.52%	1,292	-530	-762	1,320	0
대한유화	155,500	2.30	2.2	60.9	4,497	436	-0.52%	358	-615	257	257	0
현대차	168,500	-0.59	77.0	59.5	47,063	1,608	-0.05%	2,414	-428	-1,986	1,246	-3,110
SK 하이닉스	117,000	-2.50	197.1	54.8	148,924	6,201	-0.33%	-1,105	2,017	-996	1,705	-1,850
삼성전자	69,700	-1.55	574.9	52.2	999,768	43,340	-0.02%	2,999	31,880	-34,792	-37,833	309
NAVER	329,000	-0.60	122.2	50.8	28,781	1,095	-0.10%	-1,574	3,277	-1,645	-1,103	-514
현대제철	39,200	1.55	6.9	50.0	12,688	1,165	-0.11%	1,523	-879	-644	747	-1,391

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터