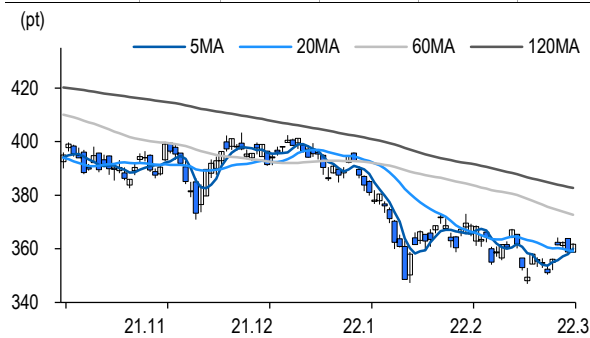


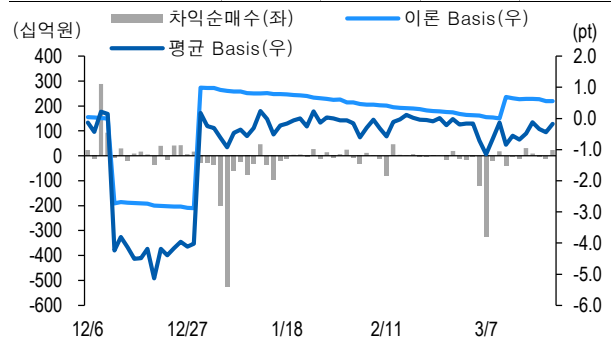
선물옵션시장 지표

2022.3.23

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	361.66	0.81	2.89	6,042.8	-
선물 6월물	361.40	0.74	2.65	17,008.0	253,986
선물 9월물	361.50	0.81	2.90	32.2	7,892
4월물(mini)	361.00	0.70	2.52	1,318.4	60,373
5월물(mini)	361.50	0.85	3.06	4.0	1,320



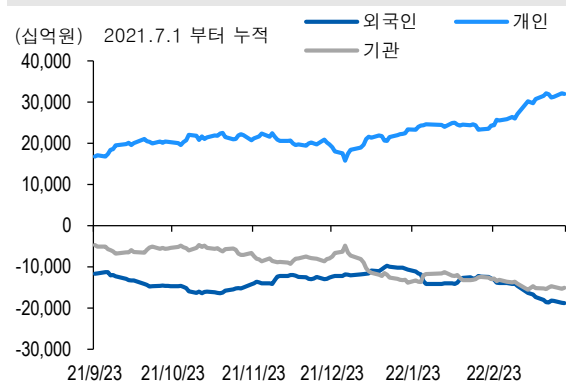
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.55	-0.17	-0.26	-0.20%
베이스(mini)	-0.28	-0.55	-0.66	-0.08%
제1스프레드(SP)	0.34	0.10	0.05	-0.07%
합성선물 베이스(ATM)	-0.28	-0.71	-0.71	-0.12%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-115.4	-4.9	-120.3	6.4	50.8	421.8	41.1	0.5	-1.3	36.3
개인	-185.2	63.2	-122.1	0.0	-8.1	-178.3	-32.6	-1.2	-0.7	-21.0
기관	285.6	-63.5	222.2	16.7	-13.3	-224.7	-7.9	1.1	2.1	-14.5
금융투자	266.5	-72.3	194.2	4.1	-19.1	-443.6	-8.0	1.2	1.5	9.2
투신	8.0	2.7	10.7	0.0	8.9	191.1	-0.2	-0.1	0.0	-7.8
은행+보험+기타금융	-5.6	22.1	16.4	0.0	-6.1	41.6	0.2	0.0	0.6	-0.2
연기금+국가자재	26.5	-9.0	17.5	12.6	4.9	-13.7	0.0	0.0	0.0	-15.7
기타법인	15.0	5.2	20.2	0.0	-1.0	-18.8	-0.5	-0.4	-0.2	-0.8

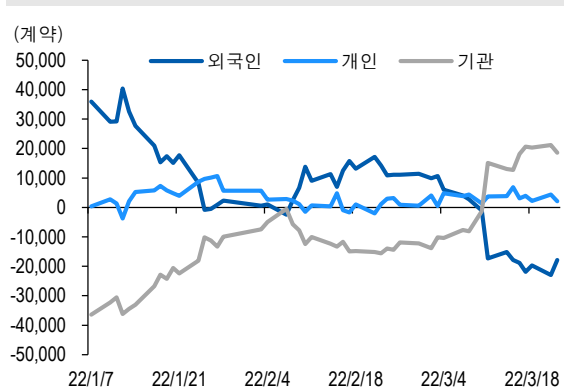
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	418,901	155.5	684,227	17.5%	지수옵션 전체	894,612	318.8	1,826,792
Put	475,711	163.3	1,142,565	20.8%	PCR(금액기준)	1.05	VKOSPI	21.03%(-1.37%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	367.5(K+3)	3.90	0.42	14,449	6,985	-26	17.4	Put	362.5(K+1)	7.73	-1.79	1,815	4,443	308	19.4
	365.0(K+2)	4.98	0.56	9,786	7,711	736	17.8		360.0(K+0)	6.63	-1.64	5,294	7,088	646	19.8
	362.5(K+1)	6.20	0.67	5,261	6,664	608	18.2		357.5(K-1)	5.61	-1.56	3,548	3,397	111	20.1
	360.0(K+0)	7.58	0.88	4,267	6,250	-155	18.6		355.0(K-2)	4.80	-1.43	6,818	7,041	214	20.7
	357.5(K-1)	9.09	1.13	1,210	2,793	27	19.0		352.5(K-3)	4.04	-1.29	7,902	6,507	691	21.1

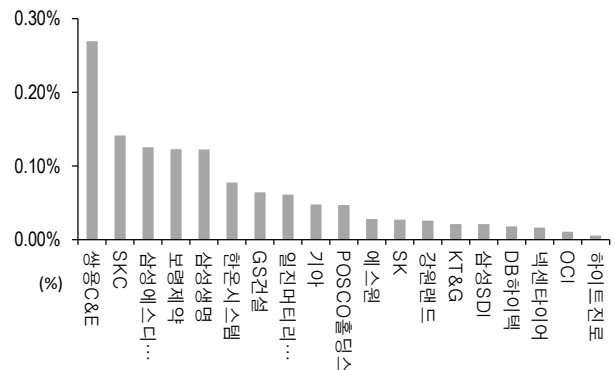
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,764,962	2,017.3	4,360,790	47,290	55,951	-13,243	-40,302	36.3	-21.0	-14.5	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	70,000	0.57	487.5	74.2	1,041,589	-2,365	-0.01%	13,633	-9,360	-3,578	9,452	-11,500
카카오	106,500	0.95	151.5	69.4	82,223	-1,508	-0.34%	-3,132	1,285	1,876	5,483	-2,650
롯데케미칼	204,500	-0.49	7.5	65.1	4,610	-352	0.00%	108	-205	97	29	41
하나금융지주	48,300	2.11	18.7	62.3	77,406	-1,095	-0.05%	-2,188	-1	2,419	238	2,181
현대차	174,000	2.65	110.4	59.8	50,185	919	-0.14%	3,807	-3,439	-397	-118	-279
SK 하이닉스	123,500	1.65	163.0	59.7	173,273	6,371	-0.28%	9,541	-14,039	4,447	4,050	-410
호텔신라	79,500	-0.25	12.0	57.5	23,833	1,154	-0.10%	-653	-162	815	-246	1,606
대한유화	160,500	-0.31	1.5	50.1	5,147	209	-0.22%	313	-441	118	76	42
LG 이노텍	411,500	1.60	72.3	49.8	15,633	1,145	-0.07%	-193	-317	491	698	-207
POSCO 홀딩스	291,000	2.28	44.8	48.1	20,465	1,599	0.05%	-459	702	-402	-1,248	273

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터