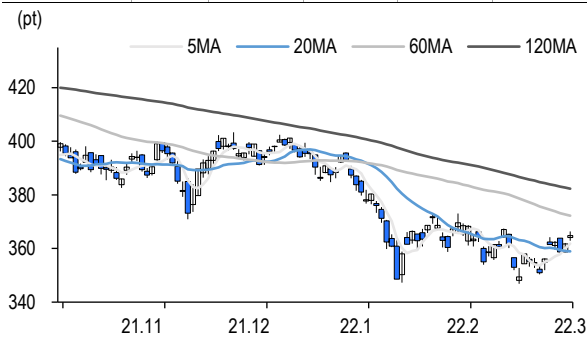


선물옵션시장 지표

2022.3.24

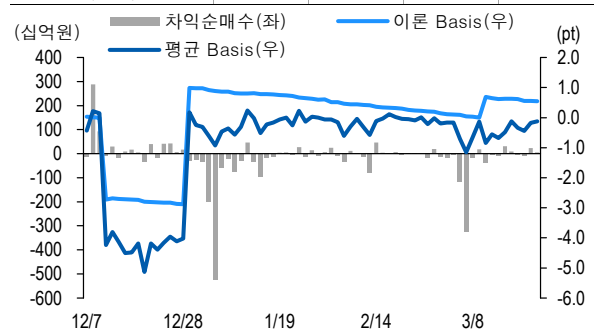
Market Data (십억원, 계약)

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	364.84	0.88	3.18	7,071.1	-
선물 6월물	364.25	0.79	2.85	18,001.3	254,151
선물 9월물	364.30	0.77	2.80	20.4	7,887
4월물(mini)	363.80	0.78	2.80	1,470.5	64,940
5월물(mini)	364.32	0.78	2.82	7.7	1,399



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.55	-0.12	-0.59	-0.18%
베이스스(mini)	-0.29	-0.55	-1.04	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.36	0.05	0.05	-0.08%
합성선물 베이스스(ATM)	-0.29	-1.02	-1.02	-0.20%

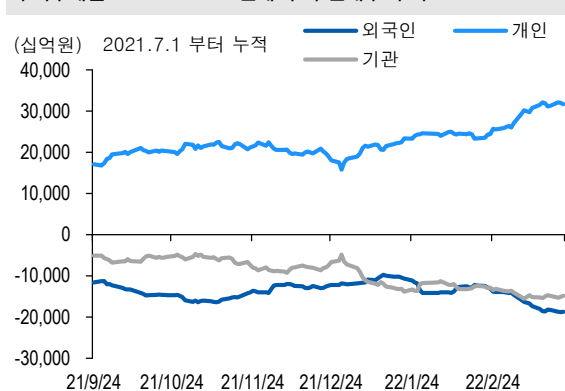


투자주체별 매매 동향 (십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	58.2	41.6	99.8	6.3	79.8	37.4	8.9	-1.2	1.6	-19.8
개인	-299.7	-5.8	-305.5	0.0	1.3	-94.5	-37.6	1.3	-3.3	62.5
기관	235.6	-42.8	192.8	-0.4	1.8	94.7	30.4	-0.2	1.9	-44.9
금융투자	233.1	-35.1	198.0	1.4	0.9	37.9	31.7	-0.5	1.8	-50.6
투신	-31.1	17.0	-14.1	0.0	-12.8	15.0	-1.1	0.0	0.0	16.2
은행+보험+기타금융	-21.3	-17.5	-38.8	0.0	-4.3	43.6	-0.2	0.3	0.0	0.2
연기금+국가자재	55.3	-3.9	51.4	-1.8	20.1	-1.8	0.0	0.0	0.0	-10.7
기타법인	5.9	7.0	12.9	0.0	0.2	-37.6	-1.8	0.0	-0.2	2.1

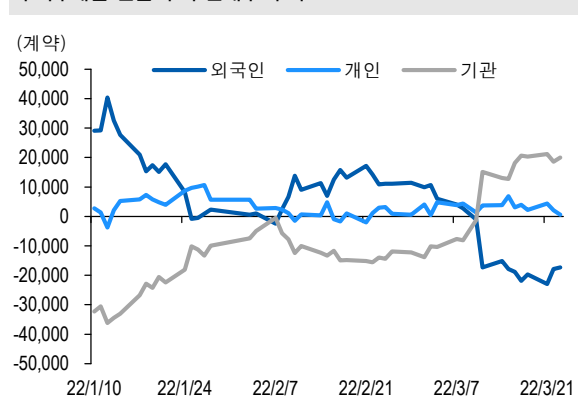
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



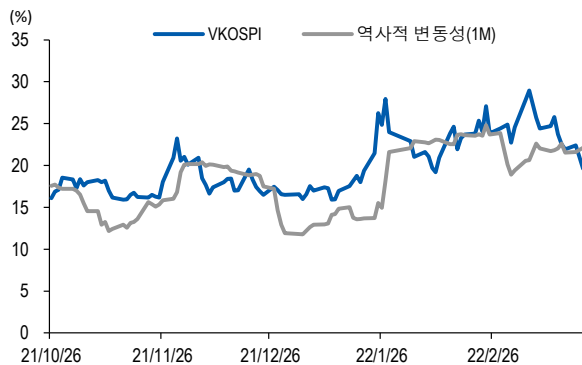
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	513,552	188.5	699,951	15.5%	지수옵션 전체	1,134,035	380.2	1,871,502
Put	620,483	191.7	1,171,551	19.3%	PCR(금액기준)	1.02	VKOSPI	19.61%(-1.42%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	370.0(K+3)	3.40	0.42	26,321	13,850	-934	15.5	Put	365.0(K+1)	6.83	-2.20	5,927	5,010	614	18.1
	367.5(K+2)	4.45	0.55	8,655	7,047	62	15.8		362.5(K+0)	5.74	-1.99	6,419	5,104	661	18.5
	365.0(K+1)	5.68	0.70	7,658	8,124	413	16.1		360.0(K-1)	4.83	-1.80	13,839	9,516	2,428	19.0
	362.5(K+0)	7.06	0.86	3,191	6,847	183	16.4		357.5(K-2)	4.03	-1.58	8,433	3,674	277	19.4
	360.0(K-1)	8.66	1.08	2,568	5,813	-437	16.8		355.0(K-3)	3.35	-1.45	14,549	8,116	1,075	19.8

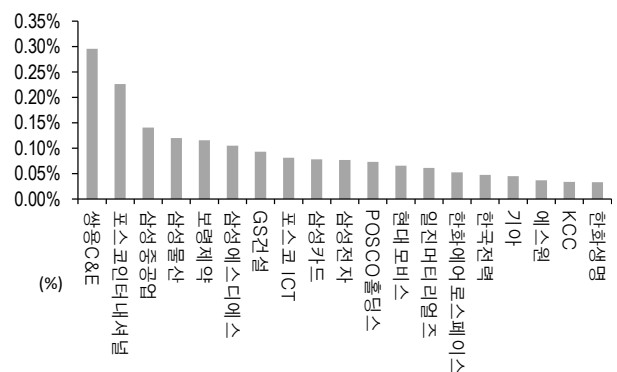
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,997,251	2,281.7	4,400,542	39,752	-18,924	90,993	-74,933	-19.8	62.5	-44.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	70,200	0.29	556.6	63.7	1,031,982	-9,607	0.08%	-17,611	38,441	-20,967	-16,669	-1,690
SK 하이닉스	123,000	-0.40	315.7	63.1	174,036	763	-0.38%	-9,055	5,143	3,892	4,546	-30
GS 건설	47,400	1.17	19.6	61.0	70,991	3,270	0.09%	-2,402	3,688	-3,954	-1,871	-2,207
카카오	107,000	0.47	146.2	59.4	89,450	7,227	-0.02%	4,961	1,520	-6,538	-6,520	-3,320
현대모비스	212,500	1.19	21.5	50.7	5,837	-862	0.07%	-549	-247	796	-528	-636
현대차	175,500	0.86	83.3	49.8	46,368	-3,817	-0.12%	-1,476	-596	2,103	971	1,856
한국전력	23,150	0.22	15.8	49.5	252,175	-3,972	0.05%	-2,642	500	2,262	4,985	-2,716
호텔신라	79,900	0.50	8.9	48.6	23,601	-232	-0.06%	388	-479	67	369	8
POSCO 홀딩스	303,500	4.30	70.7	44.9	23,170	2,705	0.07%	-22	2,787	-2,654	-2,603	-95
하나금융지주	49,400	2.28	23.9	43.8	84,029	6,623	0.02%	-3,371	9,322	-5,928	-1,886	-5,739

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터