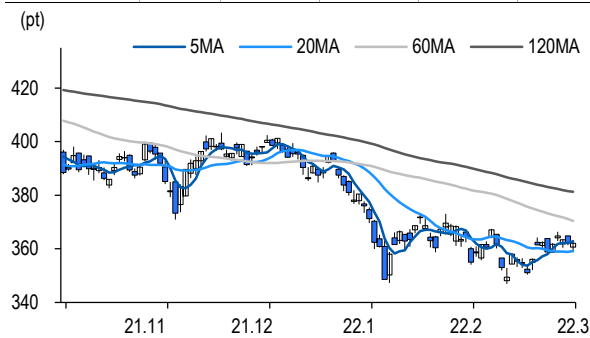


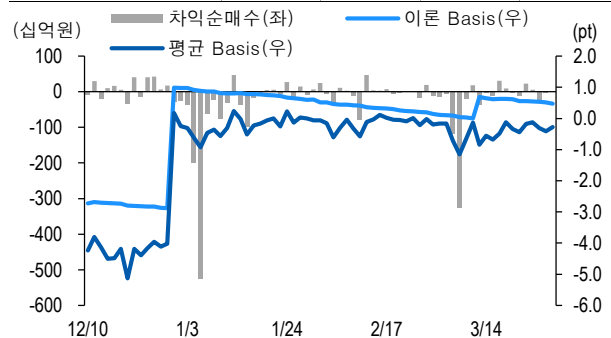
선물옵션시장 지표

2022.3.29

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	362.06	0.00	0.00	5,890.6	-
선물 6월물	362.45	0.19	0.70	17,252.9	254,046
선물 9월물	362.60	0.21	0.75	35.9	8,116
4월물(mini)	362.06	0.18	0.64	1,287.5	64,327
5월물(mini)	362.06	0.16	0.58	9.0	1,509



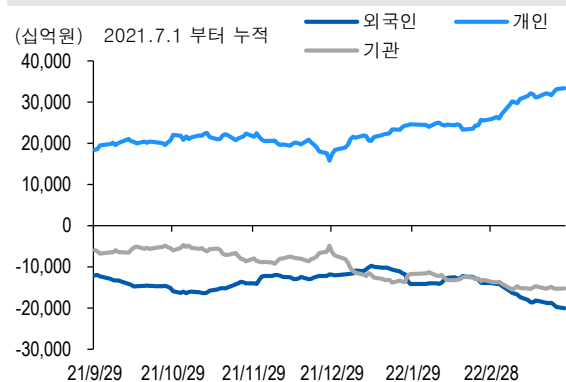
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.47	-0.28	0.39	-0.21%
베이스(mini)	-0.36	-0.63	0.00	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.35	0.05	0.05	-0.08%
합성선물 베이스(ATM)	-0.36	0.01	0.01	0.10%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-262.8	-64.8	-327.7	-2.9	-41.3	613.5	65.8	-0.1	-2.4	13.7
개인	192.1	60.3	252.4	0.0	2.6	-306.9	-40.4	-1.6	1.1	-3.8
기관	67.6	6.7	74.3	4.1	-17.3	-296.2	-25.6	1.9	1.4	-8.6
금융투자	138.2	-8.1	130.1	-8.7	0.2	-358.3	-27.8	1.8	0.9	2.6
투신	-22.4	46.7	24.3	0.0	-12.6	79.5	2.3	0.0	0.0	-11.0
은행+보험+기타금융	-16.0	-29.4	-45.3	0.0	-2.7	5.4	-0.1	0.0	0.5	4.8
연기금+국가자재	3.6	-0.7	2.9	12.8	0.5	-22.8	0.0	0.0	0.0	-5.0
기타법인	3.1	-2.2	0.9	0.0	0.7	-10.4	0.2	-0.2	-0.1	-1.2

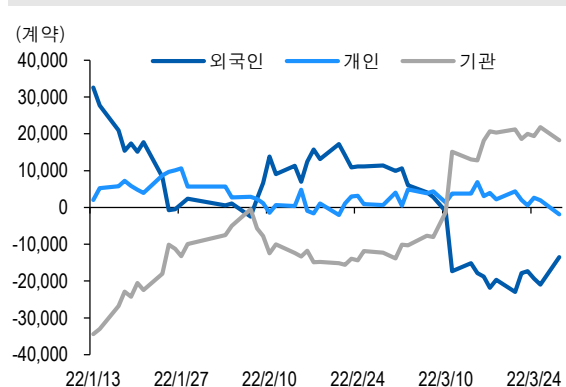
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	605,417	218.7	743,375	16.6%	지수옵션 전체	1,300,777	431.0	1,971,795
Put	695,360	212.4	1,228,420	18.1%	PCR(금액기준)	0.97	VKOSPI	19.60%(-0.02%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	370.0(K+3)	2.18	-0.09	77,086	18,584	793	16.4	Put	365.0(K+1)	6.90	-0.77	2,425	4,363	-91	15.8
	367.5(K+2)	2.99	-0.11	59,292	9,173	1,284	16.7		362.5(K+0)	5.77	-0.59	5,661	6,057	1,019	16.8
	365.0(K+1)	4.05	-0.03	27,545	8,809	219	17.2		360.0(K-1)	4.74	-0.53	8,227	10,840	463	17.4
	362.5(K+0)	5.34	0.08	12,459	7,909	374	17.8		357.5(K-2)	3.85	-0.52	8,137	4,424	142	17.9
	360.0(K-1)	6.80	0.08	5,492	6,483	502	18.5		355.0(K-3)	3.08	-0.50	21,722	8,228	-429	18.4

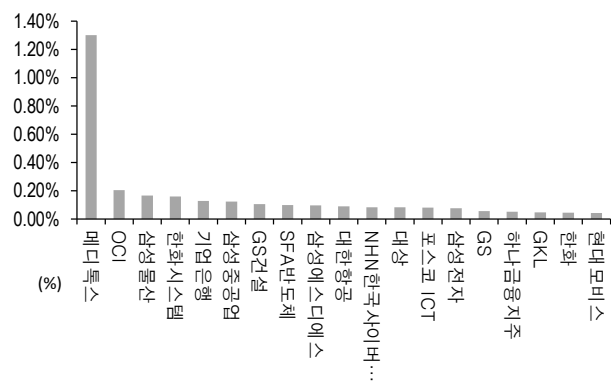
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,384,610	1,755.0	4,613,208	61,962	-21,625	31,795	-10,571	13.7	-3.8	-8.6	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	118,500	0.85	258.3	67.6	183,457	-2,080	-0.28%	3,818	4,093	-7,701	-4,926	-2,770
GS 건설	47,500	1.17	14.3	65.7	66,658	-3,202	0.11%	-1,597	1,607	-10	-850	713
카카오	105,000	0.00	93.3	58.5	93,219	3,196	-0.06%	2,241	185	-2,446	-2,753	290
현대차	174,500	0.58	45.4	56.8	46,798	-54	-0.01%	332	229	-761	90	-934
LG 화학	524,000	-0.57	51.6	53.3	11,087	316	-0.01%	561	-550	-12	984	-650
POSCO 홀딩스	296,500	0.00	39.0	49.3	21,721	-264	0.00%	658	-681	6	-216	222
삼성전자	69,500	-0.14	417.6	47.6	1,112,591	2,996	0.08%	960	-2,491	2,301	-13,698	9,040
하나금융지주	49,250	-0.30	20.1	46.9	87,031	4,032	0.05%	2,590	3,596	-6,281	-3,080	-3,223
LG 이노텍	391,500	-2.73	74.0	46.3	15,349	-90	-0.01%	-395	-517	1,175	12	1,163
삼성전기	163,500	-0.61	21.8	44.9	32,920	124	-0.06%	1,496	-306	-1,190	-172	-949

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터