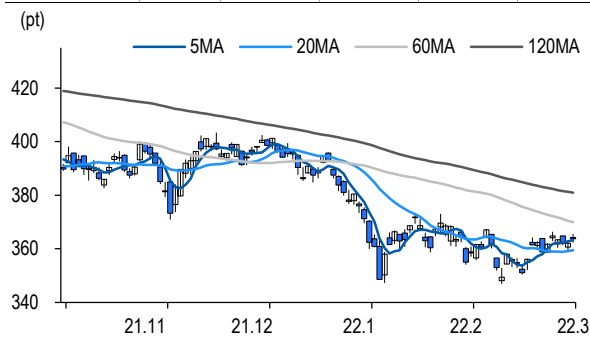


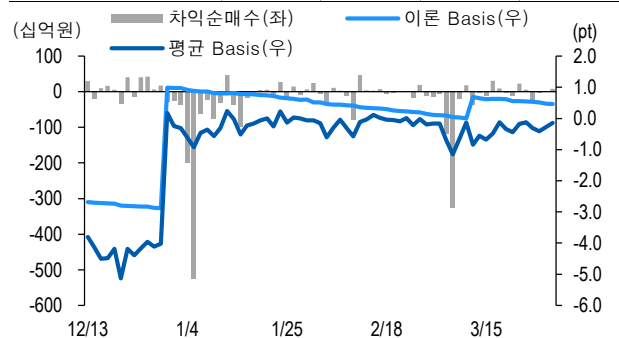
## 선물옵션시장 지표

2022.3.30

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	363.77	0.47	1.71	6,098.4	-
선물 6월물	363.55	0.30	1.10	16,081.5	252,202
선물 9월물	363.65	0.29	1.05	41.8	8,689
4월물(mini)	363.10	0.29	1.04	1,317.6	67,125
5월물(mini)	363.22	0.32	1.16	10.6	1,643



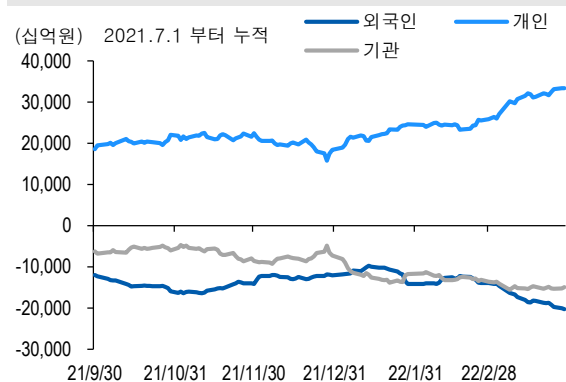
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.46	-0.14	-0.22	-0.17%
베이스(mini)	-0.38	-0.54	-0.67	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.36	0.05	0.05	-0.09%
합성선물 베이스(ATM)	-0.38	-0.68	-0.68	-0.08%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-280.1	36.0	-244.1	0.7	-63.6	-166.1	-118.9	-5.4	4.3	8.6
개인	-8.4	-9.3	-17.7	0.0	2.4	199.7	7.9	1.9	-1.5	18.3
기관	326.7	-0.3	326.4	7.5	-44.8	46.0	107.9	2.6	-3.4	-27.3
금융투자	425.5	23.5	449.0	7.4	-1.7	7.7	107.5	2.7	-1.2	-49.2
투신	-44.5	4.7	-39.8	0.0	-34.9	-11.0	0.0	0.0	0.0	16.7
은행+보험+기타금융	-22.2	-42.7	-64.8	0.0	-2.5	51.8	0.4	0.0	-2.2	-0.2
연기금+국가자재	-34.2	13.1	-21.1	0.1	-6.7	-2.5	0.0	0.0	0.0	5.3
기타법인	-38.2	-26.4	-64.5	0.0	0.7	-79.7	3.1	0.8	0.6	0.4

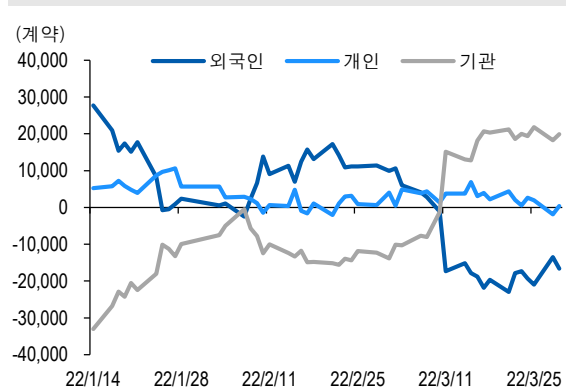
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	611,712	179.4	773,140	15.0%	지수옵션 전체	1,309,133	358.1	2,025,550
Put	697,421	178.7	1,252,410	18.1%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	18.75%(-0.85%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	370.0(K+3)	2.13	-0.05	76,196	20,953	2,369	14.9	Put	365.0(K+1)	6.02	-0.88	3,926	4,678	315	16.6
	367.5(K+2)	3.05	0.06	26,425	9,477	304	15.3		362.5(K+0)	4.89	-0.88	7,314	7,963	1,906	17.1
	365.0(K+1)	4.17	0.12	17,254	9,553	744	15.7		360.0(K-1)	3.90	-0.84	13,290	11,687	847	17.5
	362.5(K+0)	5.48	0.14	10,044	9,412	1,503	16.0		357.5(K-2)	3.07	-0.78	17,534	5,453	1,029	17.8
	360.0(K-1)	7.00	0.20	2,784	6,523	40	16.4		355.0(K-3)	2.41	-0.67	33,461	9,817	1,589	18.3

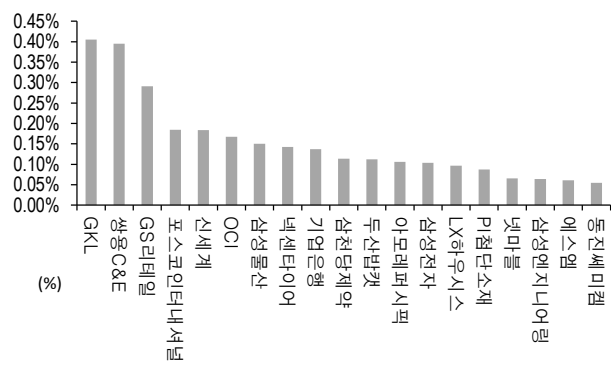
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	2,816,554	2,007.3	4,686,981	73,773	-27,117	-256	28,777	8.6	18.3	-27.3	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	120,000	1.27	302.5	77.5	207,536	24,079	-0.27%	6,566	4,633	-11,364	-21,968	1,149
현대차	176,500	1.15	70.4	73.7	47,319	521	0.01%	239	1,454	-1,693	909	-1,352
하나금융지주	49,000	-0.51	23.8	67.0	87,667	636	0.04%	273	-1,071	834	-366	1,204
엔씨소프트	463,000	1.31	21.7	65.3	8,887	-2	-0.03%	-179	-100	279	-4	-372
LG 이노텍	391,500	0.00	94.2	56.9	14,632	-717	0.00%	761	644	-1,692	90	-377
삼성전자	69,800	0.43	512.4	53.6	1,119,901	7,310	0.10%	-4,937	2,031	3,904	-15,752	11,450
LG 화학	524,000	0.00	37.9	49.9	10,749	-338	0.04%	-267	75	192	-1	193
GS 건설	46,000	-3.16	19.7	48.6	59,958	-6,700	0.04%	1,851	1,485	-2,986	2,916	529
NAVER	335,000	0.75	50.8	47.1	28,265	-229	0.04%	-307	-297	686	-279	226
카카오	105,000	0.00	64.1	46.2	97,056	3,837	-0.14%	2,189	1,231	-3,350	-1,913	-1,771

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터