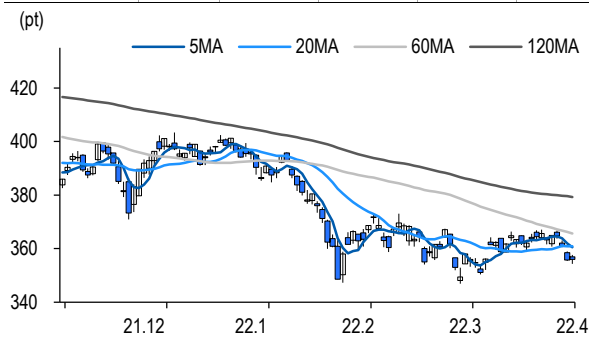


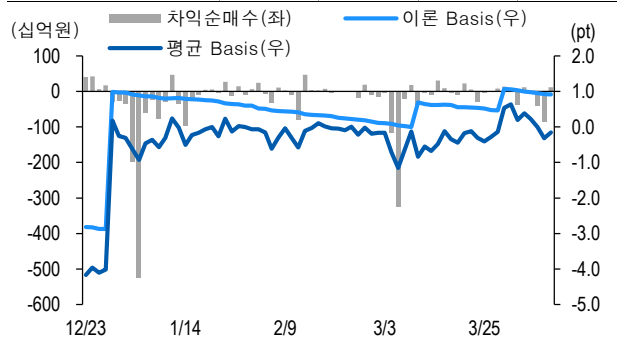
선물옵션시장 지표

2022.4.11

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	356.01	0.08	0.28	6,655.6	-
선물 6월물	356.40	0.06	0.20	17,853.1	257,483
선물 9월물	356.20	0.01	0.05	20.5	9,238
4월물(mini)	356.28	0.04	0.16	1,277.5	64,153
5월물(mini)	356.24	0.01	0.04	15.5	3,361



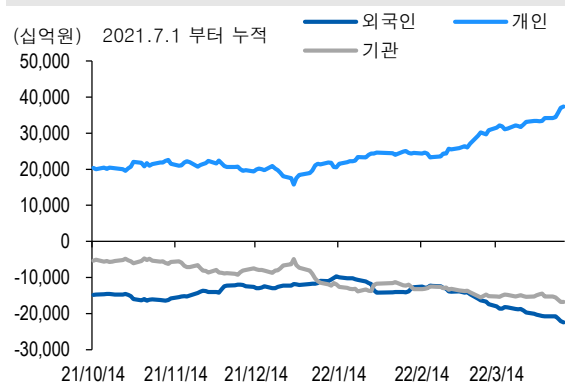
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.91	-0.15	0.39	-0.30%
베이스(mini)	0.09	-0.22	0.27	-0.09%
제1스프레드(SP)	0.33	0.00	0.00	-0.09%
합성선물 베이스(ATM)	0.09	0.39	0.39	0.08%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-453.8	57.4	-396.4	-1.7	-345.0	70.1	14.2	-1.7	2.2	-34.2
개인	422.6	-28.0	394.6	0.0	3.2	-133.2	18.1	0.7	0.6	-1.0
기관	10.0	-26.8	-16.8	13.4	-37.8	2.2	-32.1	1.6	-2.5	34.8
금융투자	-2.9	-28.4	-31.3	-0.8	-5.6	-303.2	-33.2	1.7	-2.1	28.8
투신	6.0	6.6	12.7	0.0	0.1	303.1	0.0	-0.1	0.0	43.7
은행+보험+기타금융	-22.0	-4.9	-26.9	0.0	-14.6	19.2	1.1	0.0	-0.4	0.0
연기금+국가자재	18.6	-2.7	15.9	14.3	-18.5	-16.9	0.0	0.0	0.0	-37.7
기타법인	21.2	-2.6	18.6	0.0	-1.9	61.0	-0.2	-0.5	-0.3	0.4

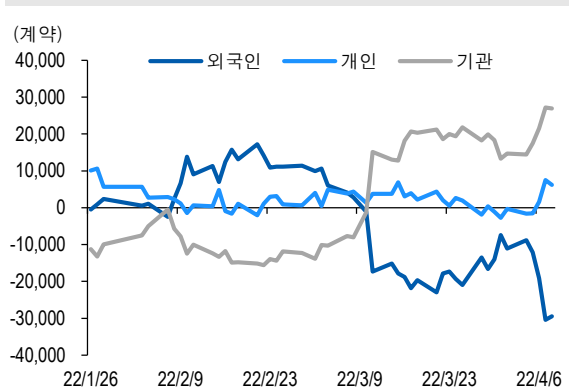
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,044,411		202.1		1,009,799		13.7%		지수옵션 전체	2,102,369		446.2		2,534,560			
Put	1,057,958		244.1		1,524,761		15.3%		PCR(금액기준)	1.21		VKOSPI		17.10%(−0.68%p)			
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		
Call	362.5(K+3)	0.62	−0.26	190,294	25,458	6,376	13.5	Put	357.5(K+1)	3.39	−0.54	20,531	12,636	653	13.4		
	360.0(K+2)	1.22	−0.35	185,061	22,273	3,481	13.8		355.0(K+0)	2.21	−0.53	81,170	20,303	1,394	13.9		
	357.5(K+1)	2.20	−0.36	111,543	16,520	6,177	14.4		352.5(K−1)	1.41	−0.44	101,503	15,487	1,134	14.6		
	355.0(K+0)	3.61	−0.28	43,508	10,559	4,036	15.4		350.0(K−2)	0.87	−0.37	159,400	24,659	1,506	15.3		
	352.5(K−1)	5.34	−0.18	7,575	2,982	819	16.4		347.5(K−3)	0.51	−0.31	141,556	23,851	752	15.8		

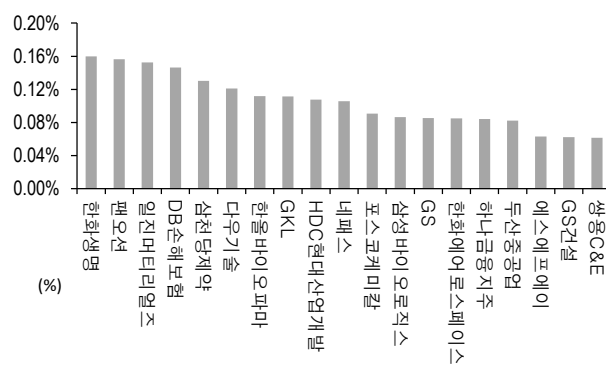
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,139,237	2,462.7	4,824,394	15,590	-55,900	-24,826	80,629	-34.2	-1.0	34.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금융 순매수
한국금융지주	75,900	-0.13	7.2	79.9	14,583	-3,314	-0.03%	-655	-162	885	867	18
현대차	177,000	-1.39	62.2	77.0	45,826	-7,454	0.05%	-1,010	-1,494	2,504	416	2,274
호텔신라	83,000	0.24	14.1	74.8	20,980	-2,209	0.00%	-1,184	189	995	-636	953
SK 하이닉스	112,500	-1.32	349.3	73.9	177,677	-97	0.03%	-12,992	12,121	1,101	-1,406	40
KT	36,350	0.69	22.0	64.3	43,563	-794	-0.04%	-4,561	1,597	2,964	1,321	1,643
현대건설	44,900	0.90	13.5	60.2	27,864	-1,033	-0.12%	241	-2,066	1,834	-2,064	-222
POSCO 홀딩스	283,000	0.53	30.0	58.3	21,086	-58	-0.01%	-938	-637	1,575	908	721
현대제철	40,400	0.87	5.0	55.0	19,502	-455	0.00%	153	-760	607	751	-144
LG 이노텍	382,000	1.33	49.3	54.7	13,100	-177	0.00%	-221	-275	526	526	-22
엔씨소프트	457,000	-0.87	21.1	53.5	10,657	-177	0.06%	-334	228	117	-300	374

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터