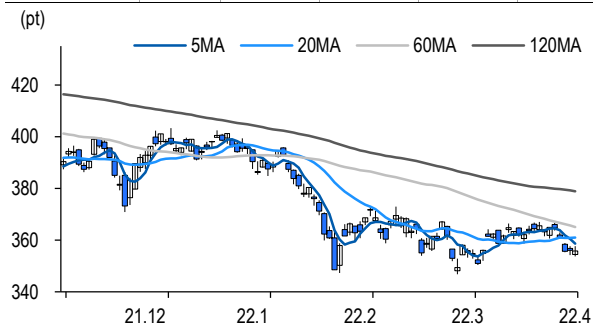


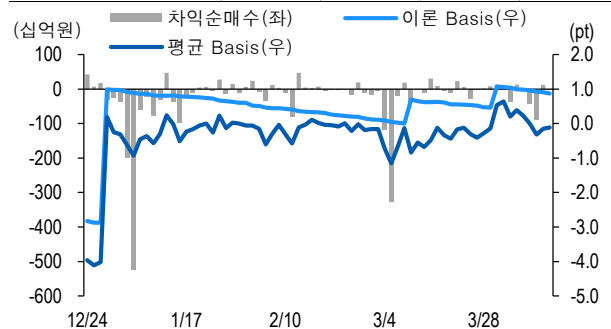
선물옵션시장 지표

2022.4.12

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	355.78	-0.06	-0.23	5,668.3	-
선물 6월물	356.05	-0.10	-0.35	21,690.5	253,786
선물 9월물	356.05	-0.04	-0.15	36.3	9,267
4월물(mini)	355.98	-0.08	-0.30	1,436.2	58,523
5월물(mini)	356.00	-0.07	-0.24	32.7	4,337



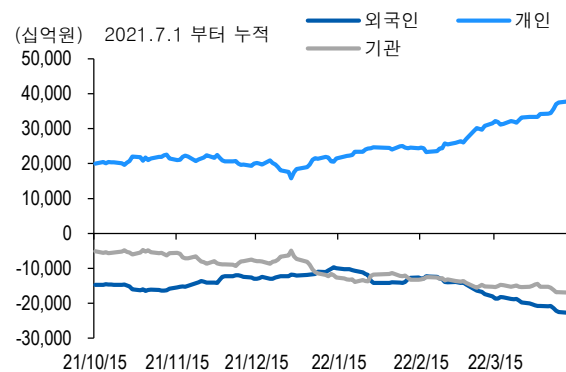
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.87	-0.11	0.27	-0.28%
베이스(mini)	0.04	-0.24	0.20	-0.08%
제1스프레드(SP)	0.34	0.00	0.00	-0.10%
합성선물 베이스(ATM)	0.04	0.13	0.13	0.02%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-134.3	-40.1	-174.4	1.1	-108.5	346.0	-37.4	3.7	-0.3	-21.1
개인	125.9	145.1	271.0	0.0	-20.0	-119.5	-30.1	-3.8	0.8	10.9
기관	1.8	-113.0	-111.2	-3.1	-11.4	-302.3	68.3	1.0	0.3	8.6
금융투자	-41.9	-157.3	-199.2	-10.3	-1.8	-170.9	67.8	2.3	0.0	-6.9
투신	32.5	8.6	41.1	0.0	13.2	-117.8	0.6	0.0	0.2	6.2
은행+보험+기타금융	-17.0	31.3	14.3	0.0	-13.3	2.2	-0.1	-1.3	0.1	0.7
연기금+국가지자체	15.0	-0.4	14.6	7.2	-9.4	-15.9	0.0	0.0	0.0	8.6
기타법인	6.6	8.0	14.6	0.0	-3.7	75.8	-0.8	-1.0	-0.8	1.6

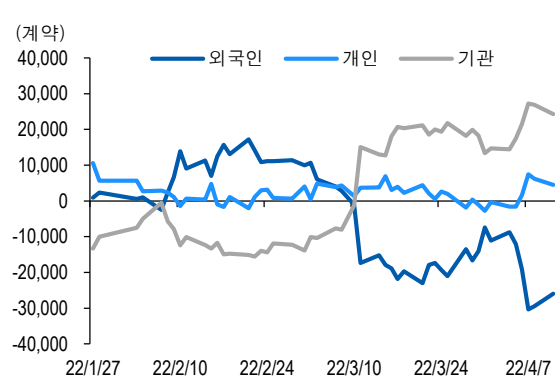
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,355,228	289.2	1,060,813	15.7%	지수옵션 전체	2,848,687	625.1	2,648,344
Put	1,493,459	336.0	1,587,531	17.8%	PCR(금액기준)	1.16	VKOSPI	17.57%(+0.47%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	362.5(K+3)	0.35	-0.27	278,641	30,212	4,754	15.3	Put	357.5(K+1)	3.30	-0.09	29,098	14,894	2,258	16.0
	360.0(K+2)	0.83	-0.39	272,675	26,103	3,830	15.7		355.0(K+0)	2.04	-0.17	128,778	25,235	4,932	16.4
	357.5(K+1)	1.69	-0.51	215,601	20,931	4,411	16.3		352.5(K-1)	1.23	-0.18	164,916	18,595	3,108	17.3
	355.0(K+0)	2.95	-0.66	108,403	19,156	8,597	16.9		350.0(K-2)	0.66	-0.21	280,085	28,030	3,371	17.6
	352.5(K-1)	4.60	-0.74	16,601	4,324	1,342	17.6		347.5(K-3)	0.37	-0.14	219,553	26,838	2,987	18.6

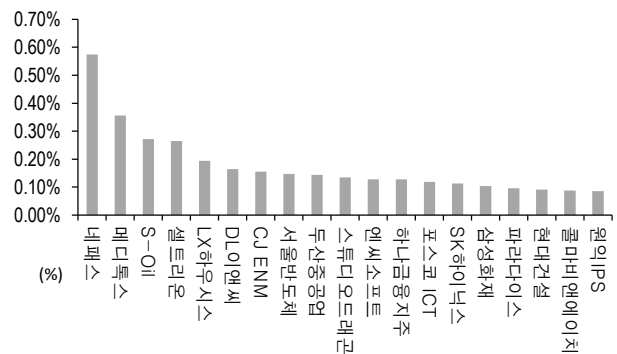
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,184,601	2,533.4	4,905,954	81,560	-11,253	17,730	-6,084	-21.1	10.9	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	111,500	-0.89	244.9	91.8	169,925	-7,752	0.11%	4,465	-594	-3,771	-2,572	-1,200
현대건설	45,050	0.33	12.9	85.7	22,152	-5,712	0.09%	-1,798	46	1,752	-7,332	-3,286
삼성전자	67,900	-0.15	676.7	81.4	636,910	-112,547	-0.08%	-8,124	8,333	-78	-1,798	-390
현대차	179,500	1.41	89.7	78.0	44,819	-1,007	0.05%	69	278	-317	-1,393	1,485
LG 생활건강	884,000	1.96	26.0	76.8	3,386	-514	0.02%	-60	-357	417	-510	-292
일진머티리얼즈	95,700	-7.54	37.2	72.0	65,558	-20,857	0.06%	-3,583	4,984	-1,401	-2,552	1,624
고려아연	615,000	-2.07	16.6	64.3	1,167	-1,121	-0.30%	70	116	-188	1,012	40
POSCO 홀딩스	286,000	1.06	35.9	64.0	18,436	-2,650	0.04%	-102	245	-260	-68	-253
GS 건설	43,100	-0.46	9.9	63.3	42,585	-6,910	0.02%	393	-5,460	4,967	1,118	3,847
LG 디스플레이	18,350	-2.39	17.3	57.8	166,183	-8,982	-0.28%	5,547	353	-5,900	8,631	10,270

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터