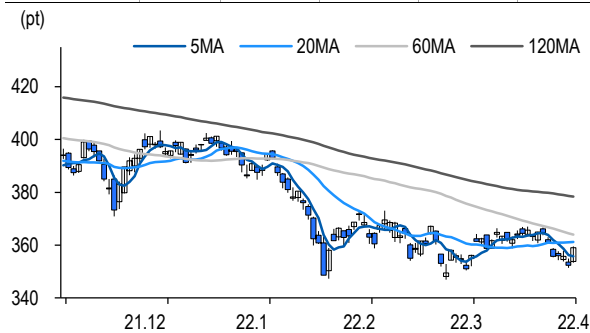


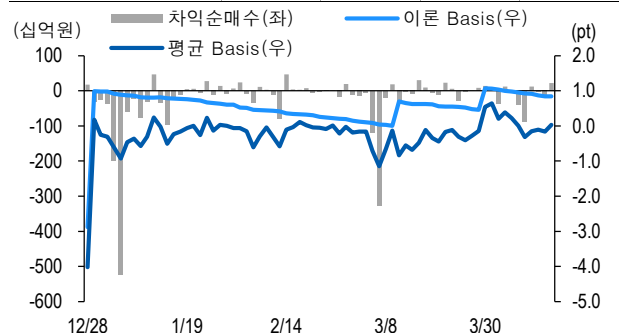
선물옵션시장 지표

2022.4.14

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	359.00	1.90	6.68	6,151.2	-
선물 6월물	358.80	1.74	6.15	25,396.4	264,373
선물 9월물	359.15	1.89	6.65	40.9	9,347
4월물(mini)	358.68	1.70	5.98	1,611.6	51,181
5월물(mini)	358.88	1.76	6.20	192.0	9,963



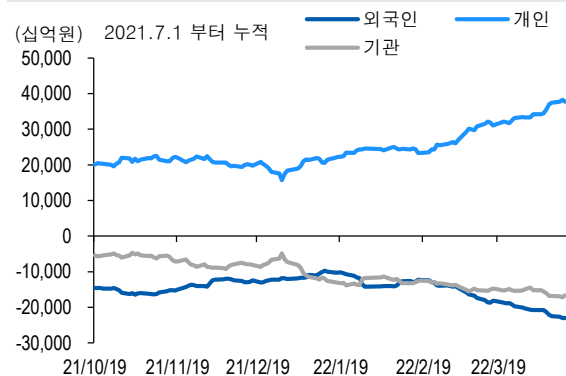
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.85	0.03	-0.20	-0.23%
베이스(mini)	0.01	-0.15	-0.32	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.35	0.00	0.00	-0.10%
합성선물 베이스(ATM)	0.01	-0.40	-0.40	-0.12%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-65.1	33.8	-31.3	8.4	11.0	530.9	40.5	5.4	-0.5	26.7
개인	-584.0	60.4	-523.6	0.0	0.9	-154.6	-66.6	-2.7	0.3	20.4
기관	639.3	-114.2	525.0	13.8	54.5	-348.3	31.1	-2.8	0.3	-50.2
금융투자	326.6	-185.0	141.6	-7.7	3.7	-837.5	28.3	-2.2	0.0	-81.6
투신	63.4	14.9	78.4	0.0	-3.0	491.1	0.9	-0.4	0.1	28.4
은행+보험+기타금융	-3.1	45.3	42.2	0.0	-23.0	20.7	1.8	-0.2	0.3	0.2
연기금+국가자재	151.0	12.2	163.3	21.5	73.5	-22.6	0.0	0.0	0.0	2.8
기타법인	9.9	20.1	30.0	0.0	1.0	-28.0	-5.0	0.0	0.0	3.1

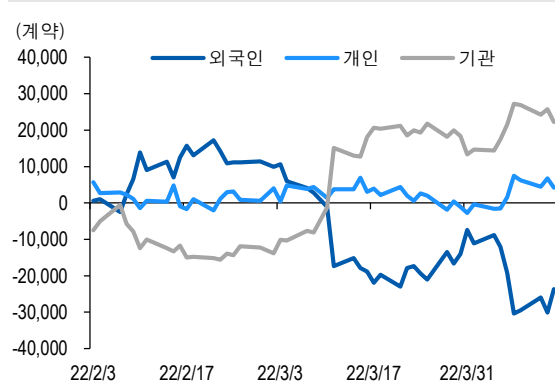
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



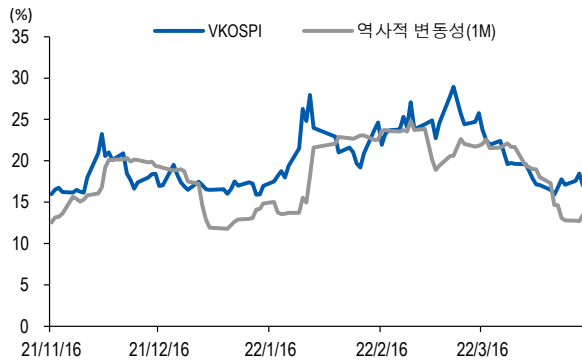
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,999,864	407.1	1,137,097	11.3%	지수옵션 전체	4,001,346	677.7	2,871,268
Put	2,001,482	270.6	1,734,171	17.6%	PCR(금액기준)	0.66	VKOSPI	17.02%(-1.45%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	360.0(K+3)	0.85	0.70	517,014	31,490	-3,129	12.0	Put	355.0(K+1)	0.30	-3.16	297,298	45,248	17,016	14.7
	357.5(K+2)	2.14	1.69	478,695	29,678	3,674	11.6		352.5(K+0)	0.10	-1.97	358,783	34,143	16,489	15.7
	355.0(K+1)	3.92	2.81	241,649	35,230	4,500	9.9		350.0(K-1)	0.05	-1.11	386,777	31,329	6,753	18.0
	352.5(K+0)	6.20	3.93	77,949	11,828	864	4.6		347.5(K-2)	0.03	-0.56	252,334	32,438	7,597	20.5
	350.0(K-1)	8.65	4.86	9,569	5,433	-101	17.4		345.0(K-3)	0.02	-0.25	148,318	23,513	-4,564	23.1

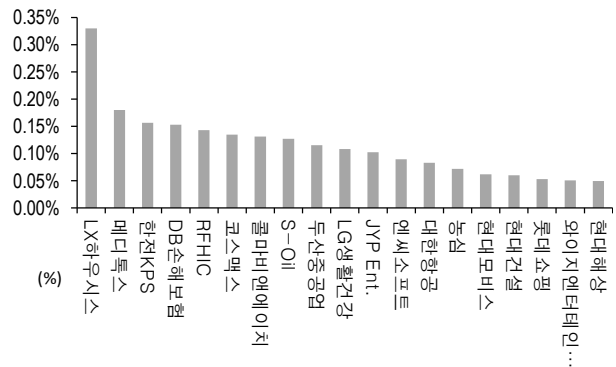
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)	
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	
주식선물 전체	3,904,084	2,911.9	5,110,224	59,500	48,975	44,900	-98,464	26.7	20.4	-50.2	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	113,000	0.89	270.2	97.3	135,041	-35,097	-0.12%	1,285	4,796	-6,074	-16,863	2,000
GS 건설	43,250	0.46	11.4	81.4	28,452	-9,442	-0.02%	1,351	-3,698	2,347	1,802	545
삼성전자	68,500	2.24	837.7	70.9	360,628	-170,890	-0.08%	4,311	38,553	-47,853	-38,893	-2,500
POSCO 홀딩스	285,000	0.53	24.0	65.4	13,055	-1,628	0.02%	-489	-249	728	30	629
현대차	180,500	1.12	54.9	61.2	42,250	-1,506	0.01%	1,448	1,199	-2,647	-2,079	-1,756
하나금융지주	47,200	0.43	19.2	59.9	45,750	-24,276	0.03%	-2,401	-6,159	8,560	999	7,561
엔씨소프트	459,000	-0.22	16.8	58.3	8,629	-1,365	0.09%	117	-161	57	-71	128
LG 생활건강	891,000	1.02	13.0	56.4	1,821	-476	0.11%	-40	-41	81	-98	-216
LG 이노텍	374,000	1.22	54.4	54.7	7,387	-3,426	0.04%	-682	231	462	318	144
코스맥스	84,000	1.20	2.6	53.9	5,738	-1,433	0.13%	147	-651	514	-858	-16

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터