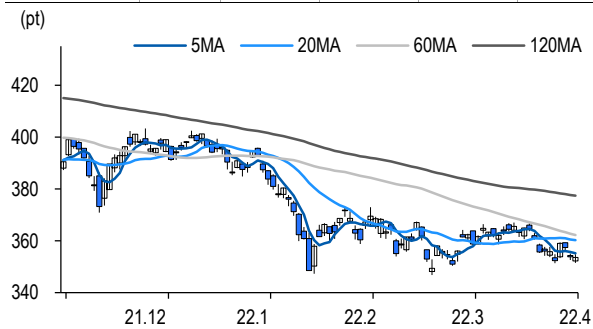


선물옵션시장 지표

2022.4.19

| Market Data | (십억원, 계약) | | | | |
|-------------|-----------|--------|---------|----------|---------|
| | 증가(pt) | 등락률(%) | 등락폭(pt) | 거래대금 | 미결제 |
| KOSPI200 | 353.63 | -0.06 | -0.21 | 4,519.3 | - |
| 선물 6월물 | 353.70 | 0.21 | 0.75 | 17,439.2 | 272,561 |
| 선물 9월물 | 353.70 | 0.18 | 0.65 | 19.2 | 8,943 |
| 5월물(mini) | 353.82 | 0.18 | 0.62 | 1,224.4 | 33,745 |
| 6월물(mini) | 352.94 | -0.01 | -0.36 | 7.7 | 2,193 |



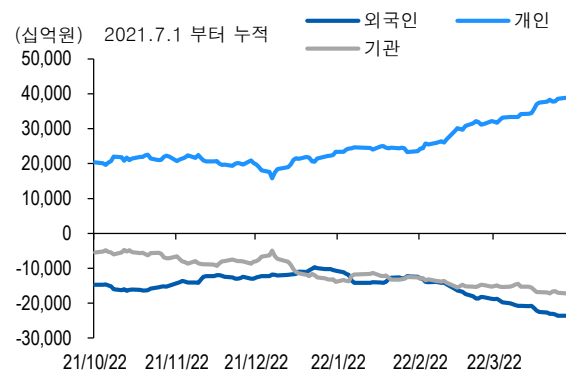
| 차익거래 관련 Market data | | | | (pt) |
|---------------------|------|-------|------|--------|
| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 과리율(%) |
| K200 베이스 | 0.87 | -0.41 | 0.07 | -0.36% |
| 베이스(mini) | 0.40 | -0.32 | 0.19 | -0.20% |
| 제1스프레드(SP) | 0.51 | 0.00 | 0.00 | -0.14% |
| 합성선물 베이스(ATM) | 0.40 | 0.22 | 0.22 | -0.05% |



| 투자주체별 매매 동향 | (십억원) | | | | | | | | | |
|-------------|-------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|
| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 |
| 외국인 | -94.7 | 81.1 | -13.5 | -3.4 | -33.7 | 382.7 | -21.1 | 3.7 | 0.1 | 7.6 |
| 개인 | 102.0 | 88.1 | 190.1 | 0.0 | -1.3 | -338.8 | -21.1 | -2.0 | 0.2 | -12.1 |
| 기관 | -18.8 | -168.4 | -187.2 | -27.7 | 10.5 | -105.5 | 44.2 | -1.8 | -0.5 | 5.6 |
| 금융투자 | -52.2 | -306.5 | -358.7 | -38.4 | -5.0 | -351.6 | 44.8 | 1.3 | -0.6 | -1.5 |
| 투신 | 36.8 | 122.4 | 159.2 | 0.0 | 8.4 | 250.8 | -0.5 | -0.6 | 0.0 | 13.1 |
| 은행+보험+기타금융 | 2.3 | 7.7 | 9.9 | 0.0 | -1.5 | 13.3 | 0.0 | -2.5 | 0.1 | 0.0 |
| 연기금+국가지자체 | 41.5 | -0.5 | 41.0 | 10.8 | 16.3 | -18.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -6.0 |
| 기타법인 | 11.5 | -0.9 | 10.6 | 0.0 | -2.6 | 61.6 | -2.0 | 0.2 | 0.2 | -1.1 |

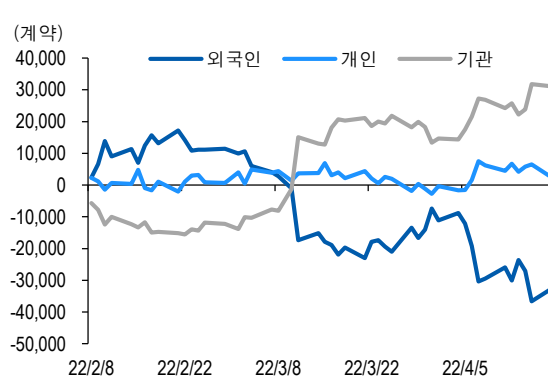
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



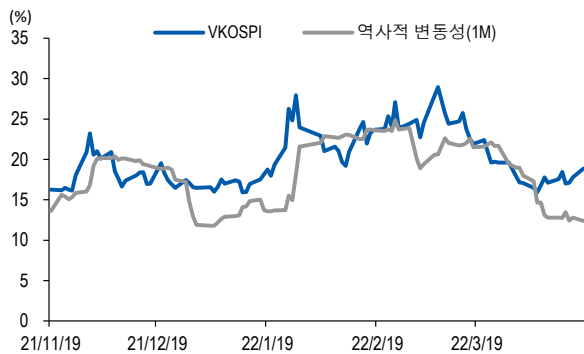
선물옵션시장 지표

| 지수옵션 시장동향 | | | | | | | | | | (계약, 십억원) | | | | | | |
|-----------|---------|--|-------|--|---------|--|-------|--|-----------|-----------|---------|------|--------|-------|-----------------|--|
| | 거래량 | | 거래대금 | | 미결제약정 | | 대표변동성 | | | 거래량 | | 거래대금 | | 미결제약정 | | |
| Call | 508,113 | | 183.8 | | 602,910 | | 15.3% | | 지수옵션 전체 | | 924,877 | | 354.7 | | 1,567,927 | |
| Put | 416,764 | | 170.9 | | 965,017 | | 17.9% | | PCR(금액기준) | | 0.93 | | VKOSPI | | 18.88%(+1.11%p) | |

| | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 |
|------|------------|------|--------|--------|-------|-------|-------|-----|------------|------|--------|-------|-------|-------|-------|
| Call | 362.5(K+3) | 2.42 | 0.10 | 46,240 | 7,559 | 2,170 | 15.2 | Put | 357.5(K+1) | 8.02 | -0.38 | 1,540 | 2,614 | 211 | 16.6 |
| | 360.0(K+2) | 3.30 | 0.20 | 39,449 | 8,592 | 1,821 | 15.6 | | 355.0(K+0) | 6.68 | -0.39 | 4,369 | 5,891 | 173 | 16.8 |
| | 357.5(K+1) | 4.33 | 0.28 | 11,380 | 4,664 | 1,127 | 15.9 | | 352.5(K-1) | 5.65 | -0.25 | 5,091 | 3,692 | 533 | 17.4 |
| | 355.0(K+0) | 5.53 | 0.25 | 8,741 | 5,818 | 992 | 16.2 | | 350.0(K-2) | 4.68 | -0.27 | 7,702 | 8,348 | 697 | 17.7 |
| | 352.5(K-1) | 6.95 | 0.40 | 3,297 | 2,601 | 972 | 16.7 | | 347.5(K-3) | 3.89 | -0.18 | 8,602 | 3,938 | 379 | 18.2 |

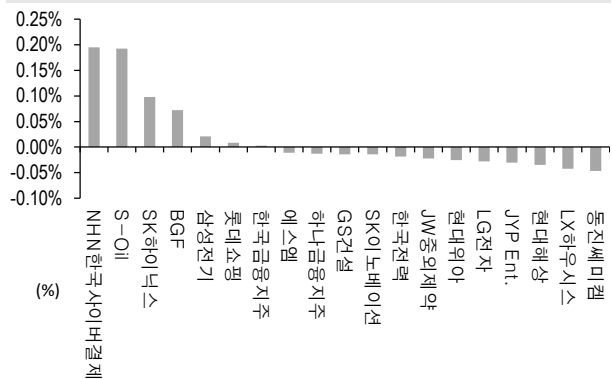
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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 | 2,716,289 | 1,916.4 | 4,310,553 | 88,397 | -38,031 | 6,416 | 33,779 | 7.6 | -12.1 | 5.6 | | |
| 종목명 | 선물현재가 (원) | 등락률 (%) | 선물거래대금 (십억원) | 선현재배율 (%) | 미결제수량 (계약) | 미결제증감 (계약) | 평균피리율 (%) | 외국인 순매수 | 개인 순매수 | 기관 순매수 | 금융투자 순매수 | 연기금등 순매수 |
| 현대차 | 178,500 | 0.85 | 51.9 | 106.0 | 47,502 | 1,861 | -0.25% | 1,723 | 1,037 | -2,782 | -1,466 | 1,302 |
| SK 하이닉스 | 109,000 | 0.46 | 298.7 | 103.1 | 174,364 | 18,176 | 0.10% | -691 | 17,324 | -16,353 | -19,506 | -6,944 |
| 삼성전기 | 157,000 | 0.00 | 28.6 | 86.2 | 26,647 | -837 | 0.02% | -1,117 | -629 | 1,746 | -559 | -2,008 |
| 삼성전자 | 66,600 | 0.00 | 547.2 | 81.0 | 1,151,446 | 9,680 | -0.24% | 17,237 | -8,966 | -8,121 | -7,130 | -1,391 |
| KB 금융 | 59,200 | -0.34 | 16.0 | 79.6 | 42,416 | 3,849 | -0.36% | -1,400 | 168 | 1,277 | 1,257 | 20 |
| 삼성 SDI | 602,000 | -1.95 | 69.8 | 69.9 | 24,782 | -2,646 | -0.21% | 833 | -3,282 | 2,441 | 1,823 | 950 |
| LG 화학 | 499,000 | -1.19 | 27.8 | 68.4 | 6,592 | -65 | -0.33% | -336 | 35 | 300 | 654 | 637 |
| 일진머티리얼즈 | 87,800 | -6.70 | 24.5 | 65.8 | 135,790 | -9,069 | -0.19% | 308 | -8,187 | 7,922 | 3,415 | 4,727 |
| LG 이노텍 | 393,500 | -1.38 | 39.2 | 64.8 | 13,048 | -89 | -0.06% | 131 | -107 | -30 | 95 | -125 |
| 신한지주 | 40,100 | -0.25 | 8.4 | 62.2 | 77,807 | 182 | -0.22% | 193 | 131 | -324 | -449 | 125 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터