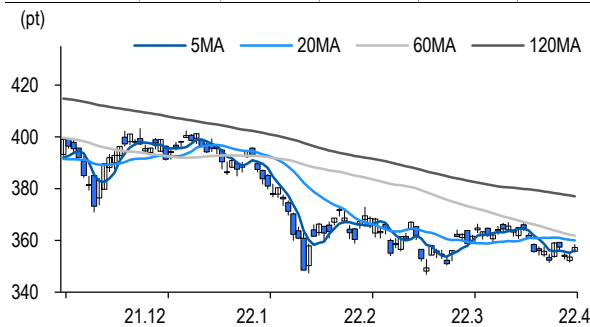


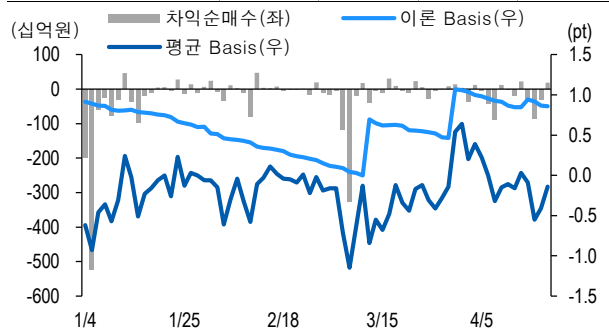
## 선물옵션시장 지표

2022.4.20

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	357.36	1.05	3.73	5,122.7	-
선물 6월물	357.20	0.99	3.50	19,214.8	267,861
선물 9월물	357.25	1.00	3.55	34.5	9,043
5월물(mini)	357.08	0.92	3.26	1,340.2	36,224
6월물(mini)	357.10	0.96	4.16	6.4	2,117



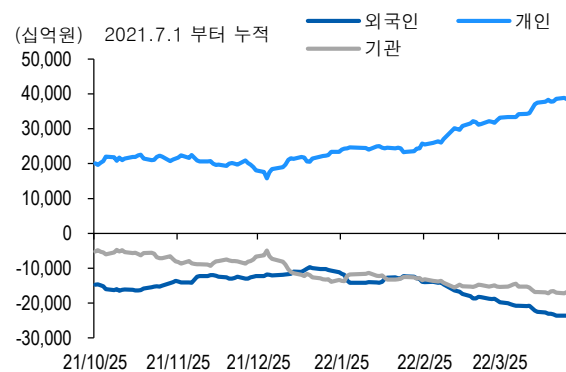
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.86	-0.14	-0.16	-0.28%
베이스스(mini)	0.39	-0.16	-0.28	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.52	0.00	0.00	-0.15%
합성선물 베이스스(ATM)	0.39	-0.26	-0.26	-0.18%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-0.2	25.5	25.3	5.9	78.2	215.7	-91.7	0.3	2.4	-6.2
개인	-343.5	2.8	-340.6	0.0	0.3	1.7	-31.7	-0.8	-1.9	8.7
기관	361.2	-35.7	325.5	13.0	17.8	-175.3	119.5	0.7	0.0	-3.2
금융투자	176.6	-47.4	129.2	-5.5	1.4	-382.9	119.0	0.8	0.1	32.9
투신	24.2	7.4	31.6	0.0	10.0	228.6	0.0	-0.1	0.0	15.5
은행+보험+기타금융	11.4	-5.3	6.1	0.0	-0.5	-2.8	0.4	0.0	0.0	0.2
연기금+국가지자체	127.6	1.2	128.8	18.1	8.3	-18.2	0.0	0.0	0.0	-51.8
기타법인	-17.5	7.4	-10.2	0.0	-1.6	-42.1	3.9	-0.2	-0.6	0.7

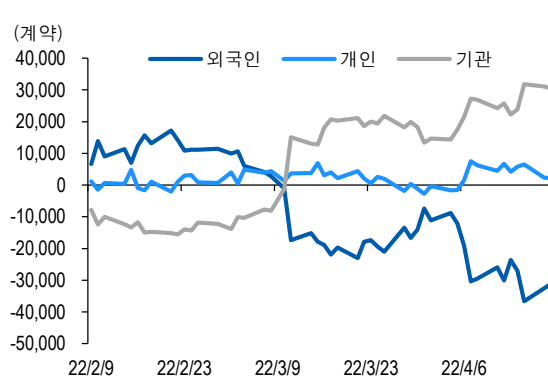
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

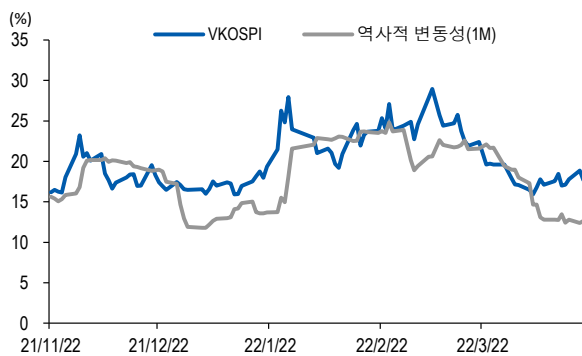
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	574,132	197.3	639,833	14.2%	지수옵션 전체	1,073,618	342.3	1,653,774
Put	499,486	145.0	1,013,941	17.9%	PCR(금액기준)	0.73	VKOSPI	17.69%(-1.19%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	360.0(K+3)	4.22	0.92	18,319	9,057	465	14.3	Put	355.0(K+1)	4.89	-1.79	8,944	8,006	2,115	17.0
	357.5(K+2)	5.49	1.16	9,520	5,420	756	14.7		352.5(K+0)	4.01	-1.64	8,721	3,798	106	17.3
	355.0(K+1)	6.89	1.36	5,446	5,720	-98	14.8		350.0(K-1)	3.20	-1.48	19,094	9,627	1,279	17.5
	352.5(K+0)	8.61	1.66	1,498	2,605	4	15.4		347.5(K-2)	2.63	-1.26	20,797	4,520	582	18.1
	350.0(K-1)	10.30	1.85	441	1,731	-15	15.5		345.0(K-3)	2.09	-1.08	29,570	13,217	1,478	18.4

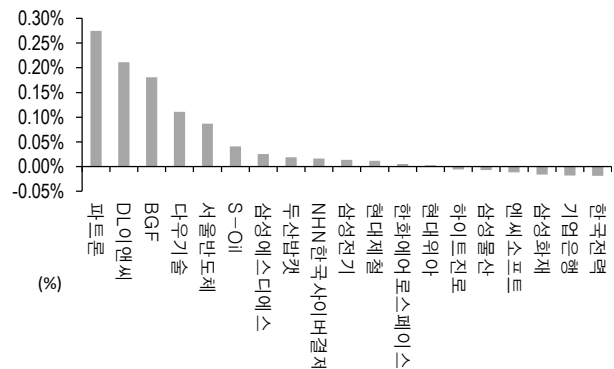
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	2,931,024	1,950.4	4,449,198	138,645	35,997	32,964	-69,760	-6.2	8.7	-3.2

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	67,300	1.05	770.8	88.3	1,189,362	37,916	-0.18%	-4,123	9,769	-6,246	35,988	-43,900
SK 하이닉스	112,000	2.75	260.7	77.4	179,989	5,625	-0.04%	5,583	-16,544	10,671	-3,123	520
일진머티리얼즈	90,400	2.96	11.4	66.2	133,244	-2,546	-0.24%	289	-2,603	2,321	2,911	-492
기아	78,300	0.13	39.5	64.3	59,499	208	-0.06%	-1,591	3,004	-1,413	-322	-1,091
현대차	181,000	1.40	70.9	63.2	51,170	3,668	-0.15%	-772	2,972	-2,200	669	-1,781
LG 디스플레이	18,900	3.00	25.5	61.6	213,558	34,660	-0.11%	7,584	41,279	-48,888	-24,182	-12,581
호텔신라	83,500	-0.12	9.1	57.3	21,259	2,229	-0.16%	-897	382	515	2,084	70
LG 이노텍	391,000	-0.64	47.4	53.9	13,066	18	-0.03%	-1,126	1,525	-396	135	-531
한국금융지주	75,200	0.53	4.5	53.8	23,142	30	-0.05%	233	254	-487	-354	-133
LG 전자	124,500	0.00	46.5	52.7	32,778	588	-0.11%	-2,620	2,492	-49	1,319	-1,367

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터