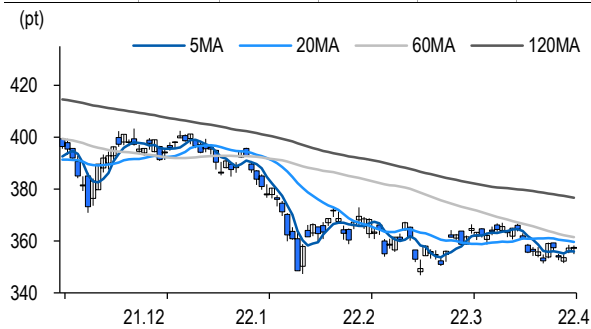


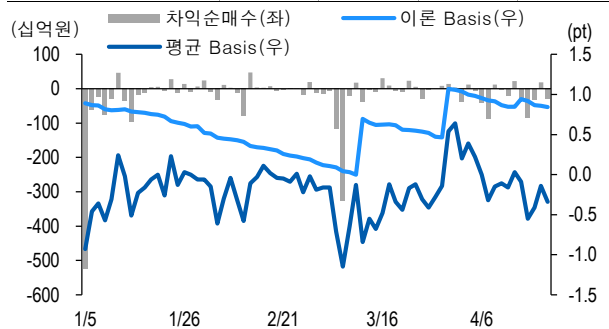
선물옵션시장 지표

2022.4.21

Market Data	(십억원, 계약)				
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	357.52	0.04	0.16	6,487.7	-
선물 6월물	356.95	-0.07	-0.25	19,759.8	269,734
선물 9월물	357.25	0.00	0.00	28.5	9,236
5월물(mini)	357.06	-0.01	-0.02	1,552.7	40,245
6월물(mini)	357.10	-0.03	0.00	5.3	2,206



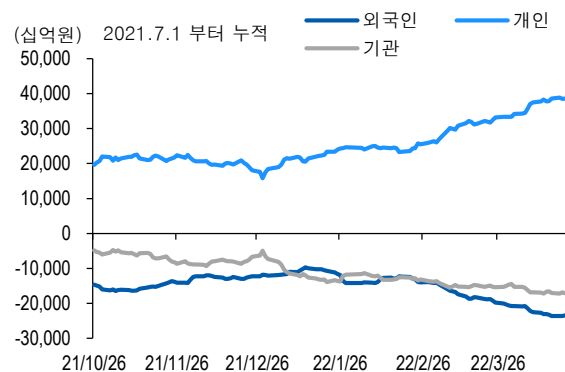
차익거래 관련 Market data	(pt)			
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.84	-0.34	-0.57	-0.33%
베이스(mini)	0.37	-0.29	-0.46	-0.18%
제1스프레드(SP)	0.53	0.05	0.05	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.37	-0.39	-0.39	-0.21%



투자주체별 매매 동향	(십억원)									
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	94.4	40.5	134.9	1.5	141.2	37.3	-67.3	0.3	-1.3	8.3
개인	75.1	19.2	94.3	0.0	-8.2	-43.3	-8.5	0.1	-0.7	14.5
기관	-161.2	-68.2	-229.5	-30.8	18.5	128.6	78.3	-1.0	2.6	-23.0
금융투자	-252.7	-94.6	-347.3	-25.0	-5.5	257.9	78.6	-1.0	3.1	-14.9
투신	43.7	9.8	53.4	-0.3	17.1	-103.0	0.2	0.0	0.0	-8.0
은행+보험+기타금융	4.9	2.9	7.7	0.0	-7.3	-21.2	-0.6	0.0	-0.5	0.1
연기금+국가지자체	52.1	7.1	59.2	-5.5	14.6	-5.1	0.0	0.0	0.0	-0.2
기타법인	-8.2	8.5	0.3	0.0	-1.4	-122.5	-2.4	0.6	-0.6	0.2

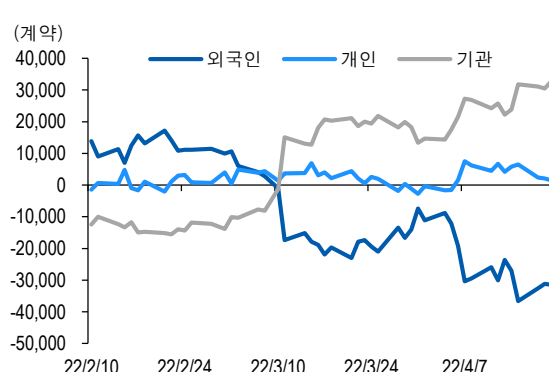
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



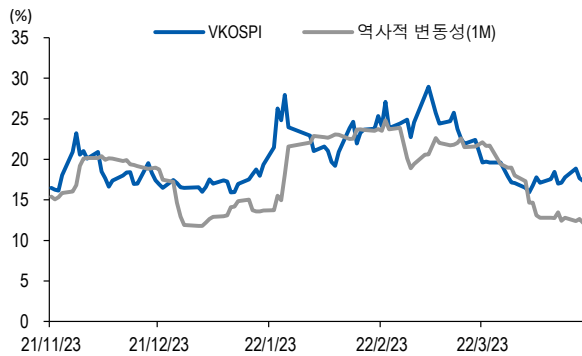
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	568,639	177.3	674,216	13.4%	지수옵션 전체	1,073,845	349.4	1,723,307
Put	505,206	172.1	1,049,091	17.1%	PCR(금액기준)	0.97	VKOSPI	17.34%(-0.35%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	365.0(K+3)	2.08	-0.24	67,701	18,768	2,960	13.3	Put	360.0(K+1)	6.84	-0.33	2,529	4,388	-216	16.0
	362.5(K+2)	2.93	-0.20	46,271	10,835	1,853	13.6		357.5(K+0)	5.59	-0.36	5,365	4,117	284	16.2
	360.0(K+1)	3.99	-0.23	21,046	9,949	892	13.8		355.0(K-1)	4.57	-0.32	12,627	8,998	992	16.6
	357.5(K+0)	5.22	-0.27	10,997	6,264	844	14.0		352.5(K-2)	3.68	-0.33	9,119	4,354	556	16.9
	355.0(K-1)	6.66	-0.23	6,512	6,338	618	14.2		350.0(K-3)	2.96	-0.24	24,580	10,924	1,297	17.3

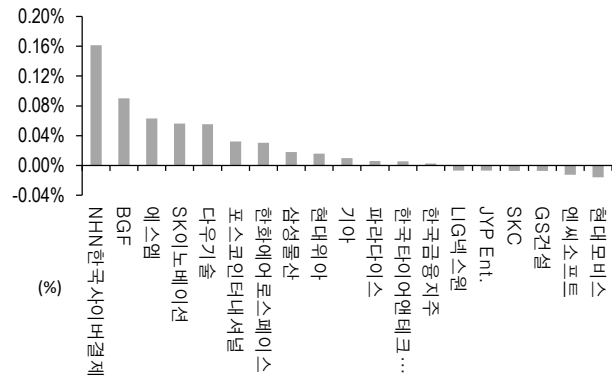
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,977,950	2,058.5	4,519,502	70,304	-9,930	13,552	-3,563	8.3	14.5	-23.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	113,000	0.89	267.8	82.5	175,951	-4,038	-0.22%	-147	2,090	-1,893	2,201	80
삼성전자	67,300	0.00	753.0	67.6	1,176,941	-12,421	-0.15%	3,200	-21,286	18,205	-3,735	22,360
LG 이노텍	391,500	0.13	40.8	54.2	13,361	295	-0.02%	701	-111	-585	-123	-462
LG 디스플레이	18,900	0.00	16.9	53.8	205,440	-8,118	-0.26%	6,332	-2,504	-3,665	7,076	4,658
현대차	183,500	1.38	78.5	52.9	52,547	1,377	-0.03%	418	577	-995	-2,338	-1,431
현대위아	69,900	4.33	20.9	47.2	16,135	9,721	0.02%	-1,392	9,916	-9,064	-7,581	-805
삼성 SDI	608,000	0.00	48.8	47.1	24,964	7	-0.17%	252	-704	455	604	19
SK 이노베이션	219,000	-0.68	25.5	43.3	18,193	1,718	0.06%	-334	2,301	-2,001	-1,253	-748
카카오	95,200	0.00	36.2	43.2	81,936	1,795	-0.13%	-148	-544	692	1,830	-843
현대제철	42,900	0.59	12.4	42.7	20,765	-2,808	-0.09%	-1,549	-301	1,850	-225	2,075

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터