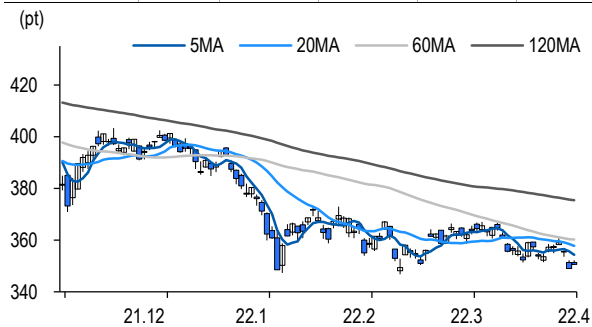


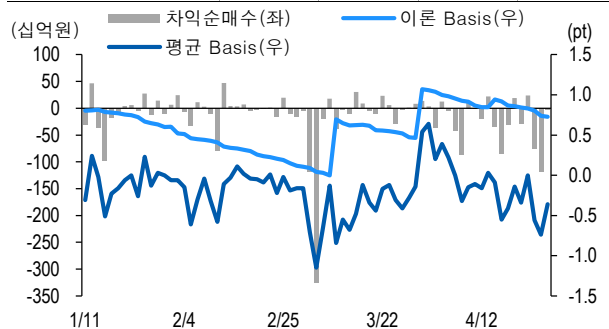
## 선물옵션시장 지표

2022.4.27

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	350.67	0.48	1.69	6,414.0	-
선물 6월물	350.05	0.49	1.70	17,198.4	280,041
선물 9월물	350.10	0.46	1.60	36.0	10,463
5월물(mini)	350.30	0.44	1.52	1,357.5	41,610
6월물(mini)	350.18	0.52	1.66	12.6	3,159



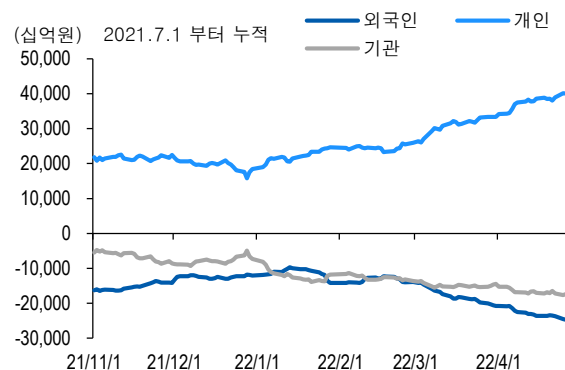
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.73	-0.36	-0.62	-0.31%
베이스(mini)	0.26	-0.27	-0.37	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.50	0.04	0.00	-0.13%
합성선물 베이스(ATM)	0.26	-0.40	-0.40	-0.19%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-252.5	19.1	-233.4	9.4	-107.6	158.6	-79.6	0.6	0.4	7.7
개인	-61.0	-11.7	-72.7	0.0	-0.7	-57.7	-2.2	-3.0	1.2	-20.8
기관	275.9	-8.0	267.9	-12.6	16.4	-110.4	74.2	2.7	-2.3	12.2
금융투자	146.6	-42.3	104.2	-12.6	1.1	-339.8	72.0	3.0	-1.8	67.5
투신	31.2	-18.4	12.8	0.0	17.4	263.6	1.1	-0.2	-0.4	-13.4
은행+보험+기타금융	-29.1	21.9	-7.1	0.0	-19.9	-33.3	1.1	-0.1	0.0	0.0
연기금+국가자재	135.4	37.2	172.6	0.0	20.1	-0.9	0.0	0.0	0.0	-42.0
기타법인	37.7	0.6	38.3	0.0	-0.1	9.4	7.5	-0.3	0.7	0.9

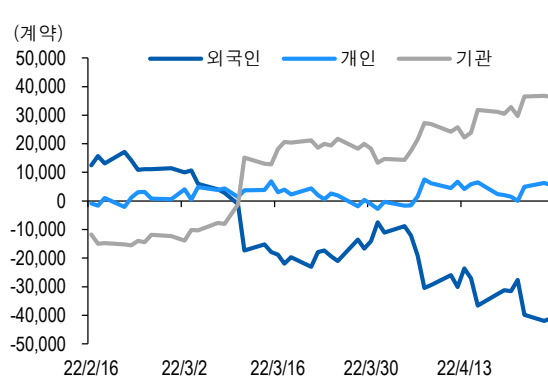
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

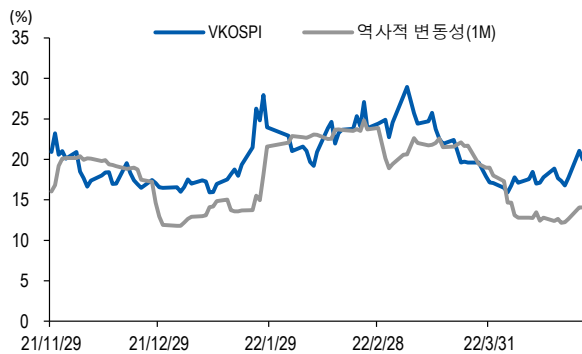
지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	562,685	173.8	761,057	15.4%	지수옵션 전체	1,119,441	359.2	1,948,977			
Put	556,756	185.4	1,187,920	20.1%	PCR(금액기준)	1.07	VKOSPI	19.94%(-1.11%p)			

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	357.5(K+3)	2.13	0.06	60,085	13,653	2,691	15.4	Put	352.5(K+1)	6.37	-1.23	4,247	6,327	129	18.4
	355.0(K+2)	3.05	0.13	29,634	11,508	1,317	15.8		350.0(K+0)	5.22	-1.17	9,679	12,006	-542	18.8
	352.5(K+1)	4.16	0.21	10,544	5,061	59	16.2		347.5(K-1)	4.26	-1.07	11,700	6,815	-650	19.4
	350.0(K+0)	5.49	0.29	8,549	5,258	391	16.6		345.0(K-2)	3.41	-0.93	23,922	14,695	14	19.8
	347.5(K-1)	6.98	0.42	1,962	1,477	112	16.9		342.5(K-3)	2.79	-0.81	30,572	9,429	394	20.5

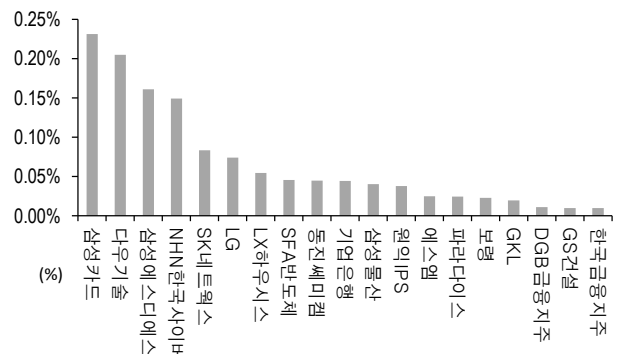
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물 평균베이스 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	2,458,911	2,010.0	4,690,358	45,012	16,004	-36,583	19,729	7.7	-20.8	12.2	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	84,900	3.54	20.2	94.3	105,247	-4,450	-0.40%	2,707	-7,661	4,954	5,010	-56
SK 하이닉스	110,500	2.31	248.9	76.6	191,063	5,417	-0.37%	7,017	-7,355	287	12,401	-7,317
LG 이노텍	370,000	-0.67	53.8	67.8	12,447	-434	-0.01%	-347	653	-326	-85	-328
현대제철	42,250	-0.24	17.7	60.6	18,378	2,498	-0.05%	-1,770	2,628	-858	-586	-295
한국조선해양	93,000	-2.11	11.1	56.3	7,736	-985	-0.09%	461	512	-973	702	13
현대차	187,500	2.74	241.5	55.3	57,603	5,314	-0.03%	-4,543	1,594	2,958	396	-3,802
삼성 SDI	580,000	0.69	45.0	53.4	23,796	313	-0.08%	-130	-225	357	455	-415
SK	261,500	0.77	18.6	50.5	12,777	1,011	0.00%	-258	971	-763	-614	-152
하나금융지주	47,200	-1.05	25.3	49.7	95,439	-875	-0.01%	-434	1,726	-1,422	904	-1,950
삼성전자	66,200	-0.15	405.5	47.7	1,204,239	24,305	-0.16%	-4,194	6,012	-1,999	21,886	-25,390

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터