

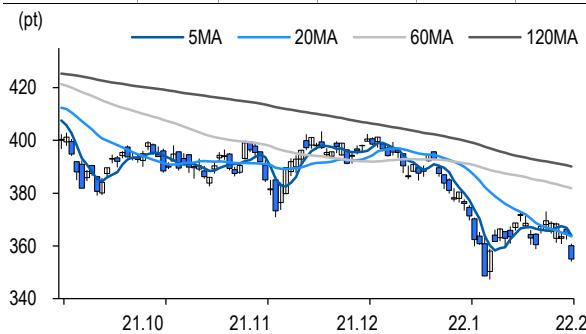


선물옵션시장 지표

2022.2.25

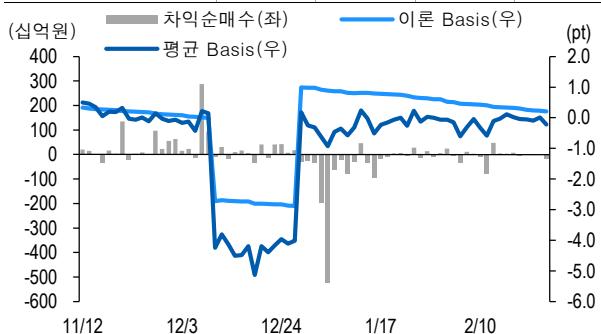
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	355.04	-2.58	-9.40	8,094.0	-
선물 3월물	354.40	-2.65	-9.65	38,630.7	288,529
선물 6월물	354.45	-2.65	-9.65	392.1	17,496
3월물(mini)	354.40	-2.65	-9.70	2,513.7	52,975
4월물(mini)	354.02	-2.81	-10.22	12.3	8,804



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.20	-0.22	-0.64	-0.12%
베이시스(mini)	0.20	-0.22	-0.64	-0.12%
제1스프레드(SP)	0.71	0.25	0.25	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.20	-0.67	-0.67	-0.25%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-684.5	-76.3	-760.8	-5.2	-323.5	85.9	-65.0	-2.2	8.5	-33.4
개인	1,118.6	215.3	1,333.9	0.0	-0.1	-31.2	45.1	-2.4	1.6	-0.4
기관	-487.5	-135.4	-622.9	-11.8	-11.8	-53.7	15.3	5.0	-9.6	34.0
금융투자	-309.0	-180.2	-489.2	-2.6	4.4	557.6	17.7	4.9	-9.5	25.8
투신	-10.0	9.7	-0.3	0.0	4.5	-609.0	-2.4	-0.3	0.0	-34.6
은행+보험+기타금융	4.3	42.3	46.7	0.0	4.4	-40.7	0.0	0.4	0.0	4.0
연기금+국가지자체	-105.8	-4.5	-110.3	-9.2	-27.1	38.4	0.0	0.0	0.0	38.8
기타법인	53.4	-3.6	49.8	0.0	0.9	-1.0	4.5	-0.3	-0.5	-0.3

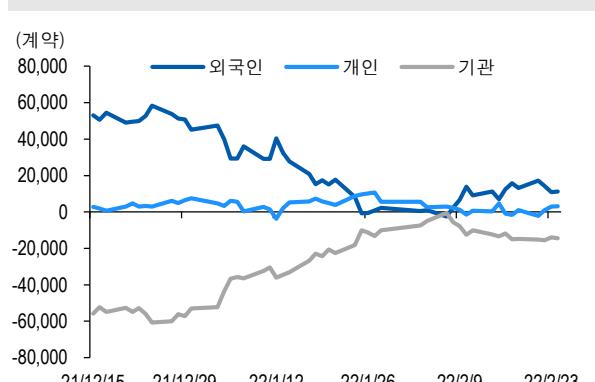
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	1,055,211	325.5	844,568	21.9%	지수옵션 전체	2,092,251	861.0	2,091,210							
Put	1,037,040	535.5	1,246,642	26.9%	PCR(금액기준)	1.65	VKOSPI	27.09% (+3.02%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	372.5(K+3)	1.15	-1.88	109,305	14,176	5,419	21.7	Put	367.5(K+1)	15.00	6.54	1,612	5,613	-355	25.0
	370.0(K+2)	1.61	-2.36	120,148	19,723	6,440	22.1		365.0(K+0)	13.55	6.30	3,926	7,880	-203	26.5
	367.5(K+1)	2.19	-2.88	57,161	9,842	2,771	22.5		362.5(K-1)	11.80	5.66	3,402	5,458	-44	26.4
	365.0(K+0)	2.92	-3.41	29,929	9,954	3,709	23.0		360.0(K-2)	10.35	5.15	10,581	22,028	-526	26.8
	362.5(K-1)	3.76	-3.97	12,444	5,614	911	23.4		357.5(K-3)	9.03	4.65	8,491	10,354	-489	27.3

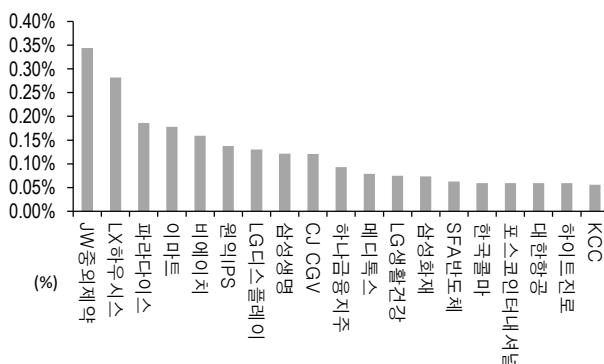
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,651,126	2,813.7	4,736,105	11,392	-47,551	15,579	31,002	-33.4	-0.4	34.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
일진마티리얼즈	87,000	-5.95	28.5	86.8	123,107	-4,441	-0.19%	-422	-4,655	5,063
POSCO	276,500	0.18	64.5	70.7	20,858	-323	-0.03%	-826	-52	878
KB 금융	61,000	-2.40	49.3	69.2	52,519	-3,573	0.03%	4,218	5,378	-9,596
LG 이노텍	322,500	-3.73	89.8	64.9	15,964	-966	0.01%	-1,127	1,338	-191
삼성전기	162,500	-4.69	66.1	64.5	28,151	2,518	-0.17%	-3,059	-1,979	5,037
현대제철	38,950	-2.01	13.0	62.9	19,423	-1,876	-0.01%	-4,812	1,636	3,176
SK 하이닉스	122,500	-4.67	430.2	61.1	223,526	6,539	-0.04%	-10,865	10,183	754
하나금융지주	49,600	-2.75	35.2	60.7	77,313	4,478	0.09%	8,694	5,136	-14,102
한국조선해양	86,700	-2.36	16.4	58.2	7,323	-3,965	-0.07%	-1,675	2,935	-1,260
LG 전자	123,500	-1.59	87.2	57.7	28,225	-2,592	-0.11%	1,651	-3,492	2,141

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터