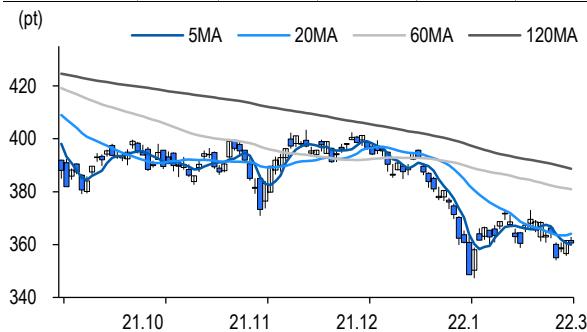


선물옵션시장 지표

2022.3.3

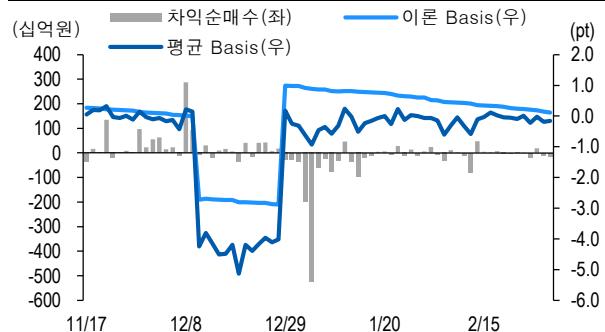
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	360.59	-0.26	-0.95	7,606.5	-
선물 3월물	360.20	-0.28	-1.00	23,611.0	278,998
선물 6월물	360.50	-0.28	-1.00	349.6	20,116
3월물(mini)	360.30	-0.25	-0.90	1,531.9	51,799
4월물(mini)	360.32	-0.21	-0.76	18.3	11,563



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.12	-0.16	-0.39	-0.08%
베이시스(mini)	0.12	-0.16	-0.29	-0.08%
제1스프레드(SP)	0.74	0.20	0.20	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.12	-0.27	-0.27	-0.11%



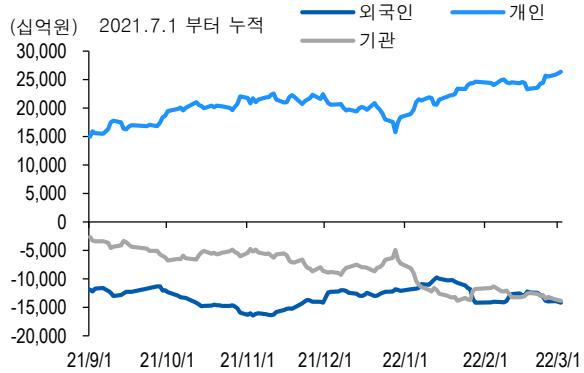
투자주체별 매매 동향

(십억원)

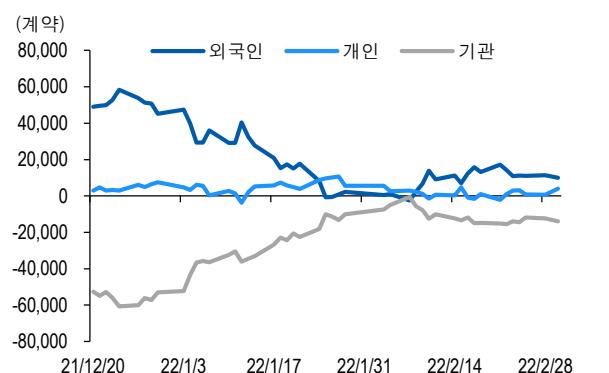
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-307.6	22.1	-285.4	1.4	-192.2	-100.0	-34.5	1.8	-0.7	-23.6
개인	428.8	60.7	489.5	0.0	-5.1	276.7	30.1	0.4	-3.4	27.1
기관	-133.5	-83.1	-216.6	-16.2	3.8	-143.6	0.8	-2.0	4.9	-5.0
금융투자	-128.8	-92.2	-221.0	0.0	4.0	-223.9	1.0	-2.1	4.8	11.3
투신	-11.9	4.1	-7.8	0.0	-3.4	38.0	-0.4	0.1	0.0	-9.0
은행+보험+기타금융	23.8	-5.2	18.6	0.0	22.4	34.3	0.1	0.0	0.1	-1.9
연기금+국가지자체	0.3	7.9	8.2	-16.2	-0.6	8.1	0.0	0.0	0.0	-5.5
기타법인	12.3	0.2	12.5	0.0	-0.9	-33.1	3.7	-0.2	-0.9	1.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	770,146	226.2	934,039	21.5%	지수옵션 전체	1,743,163	503.1	2,333,072
Put	973,017	277.0	1,399,033	25.6%	PCR(금액기준)	1.22	VKOSPI	24.89% (+0.48%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	370.0(K+3)	1.58	-0.52	95,909	28,335	1,616	21.3	365.0(K+1)
	367.5(K+2)	2.40	-0.53	58,467	16,577	1,248	22.3	362.5(K+0)
	365.0(K+1)	3.20	-0.77	28,949	13,107	1,233	22.2	360.0(K-1)
	362.5(K+0)	4.35	-0.84	11,466	8,867	1,073	22.9	357.5(K-2)
	360.0(K-1)	5.64	-0.95	6,562	8,813	469	23.4	355.0(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	365.0(K+1)	7.86	0.08	3,388	7,740	-40	24.0	
	362.5(K+0)	6.53	0.04	6,124	8,200	1,530	24.7	
	360.0(K-1)	5.26	-0.12	9,958	21,838	62	24.9	
	357.5(K-2)	4.19	-0.26	12,589	10,640	503	25.2	
	355.0(K-3)	3.36	-0.28	36,781	15,423	213	25.8	

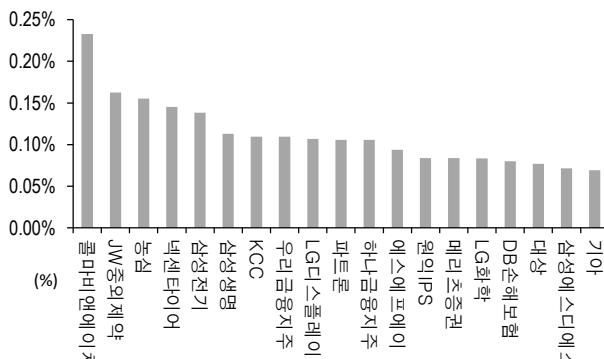
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,112,418	2,065.5	4,843,729	-14,024	-36,867	92,249	-57,836	-23.6	27.1	-5.0
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK 하이닉스	125,000	1.21	251.4	69.8	172,817	-8,868	-0.31%	-1,569	-9,210	10,835
컴투스	115,400	5.58	16.0	69.2	6,047	-4,846	-0.04%	-232	-465	697
삼성전자	71,900	-0.28	495.9	55.4	1,175,065	7,906	-0.01%	-11,894	18,982	-7,075
카카오	95,100	1.06	113.0	54.9	84,373	3,105	-0.01%	3,398	421	-3,818
일진미터리얼즈	92,000	1.32	11.7	54.3	116,318	-6,200	-0.04%	-872	705	161
LG 이노텍	321,000	-1.98	37.3	53.5	10,726	-2,051	-0.08%	233	105	-336
GS 건설	43,300	0.70	7.6	49.2	44,222	25	0.04%	379	-52	-631
한국금융지주	79,000	0.13	4.8	47.5	18,796	83	0.04%	284	429	-713
호텔신라	80,100	-0.37	10.9	43.8	26,980	1,289	-0.11%	-1,668	254	1,414
POSCO	283,500	0.18	39.6	42.0	20,175	-357	0.03%	-799	110	688

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터