

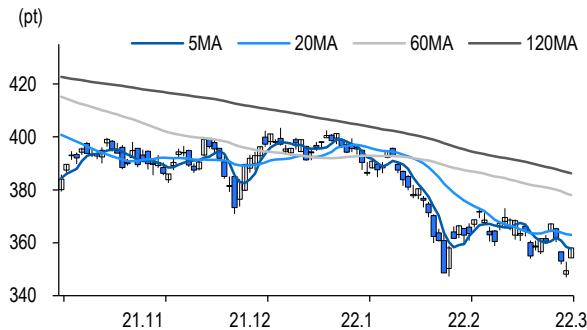


선물옵션시장 지표

2022.3.11

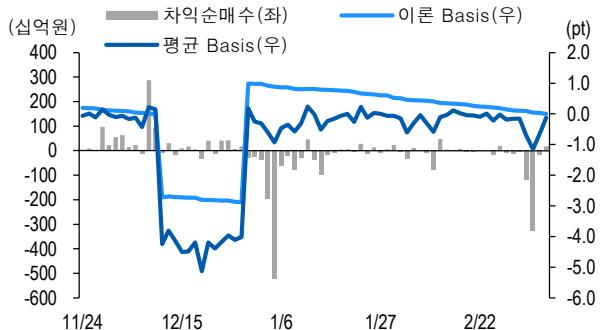
Market Data (십억원, 계약)

| | 종가(pt) | 등락률(%) | 등락폭(pt) | 거래대금 | 미결제 |
|-----------|--------|--------|---------|----------|---------|
| KOSPI200 | 358.01 | 2.47 | 8.63 | 10,645.6 | - |
| 선물 3월물 | 355.45 | 2.17 | 7.55 | 12,645.5 | 0 |
| 선물 6월물 | 356.90 | 2.85 | 9.90 | 11,221.9 | 235,785 |
| 3월물(mini) | 355.60 | 2.21 | 7.60 | 746.6 | 0 |
| 4월물(mini) | 356.42 | 2.56 | 8.90 | 935.2 | 19,802 |



차익거래 관련 Market data (pt)

| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) |
|----------------|------|-------|-------|--------|
| K200 베이시스 | 0.00 | -0.13 | -2.56 | -0.04% |
| 베이시스(mini) | 0.00 | -0.11 | -2.41 | -0.03% |
| 제1스프레드(SP) | 0.73 | -0.26 | -0.05 | -0.28% |
| 합성선물 베이시스(ATM) | 0.00 | -2.46 | -2.46 | -0.69% |



투자주체별 매매 동향

(십억원)

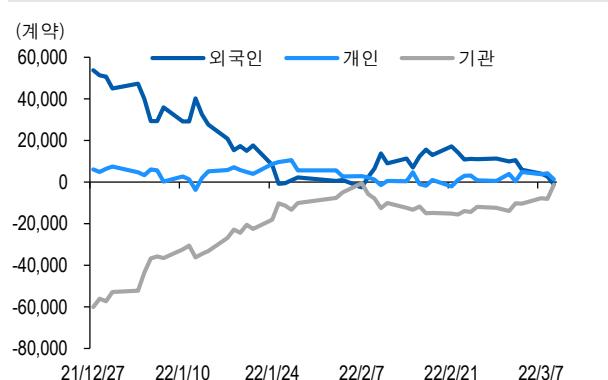
| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 |
|------------|--------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|
| 외국인 | -427.2 | 52.9 | -374.3 | 2.8 | -431.4 | -524.2 | 176.5 | 8.2 | 1.8 | 2.4 |
| 개인 | -352.5 | -113.0 | -465.5 | 0.0 | 7.1 | -217.3 | -46.6 | -3.8 | -3.2 | -16.5 |
| 기관 | 764.9 | 75.2 | 840.1 | 15.4 | 242.7 | 734.6 | -127.0 | -3.8 | 2.5 | 13.9 |
| 금융투자 | 738.8 | 56.7 | 795.5 | 15.3 | 253.8 | 204.9 | -126.9 | -1.5 | 2.5 | 89.2 |
| 투신 | 36.2 | 9.1 | 45.3 | 0.0 | -37.0 | 474.2 | 1.1 | -1.9 | -0.1 | 16.2 |
| 은행+보험+기타금융 | 26.5 | 0.6 | 27.1 | 0.0 | 27.9 | 1.7 | -1.2 | -0.3 | 0.1 | 0.2 |
| 연기금+국가지자체 | -57.2 | -14.6 | -71.8 | 0.1 | 20.5 | 53.8 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -91.6 |
| 기타법인 | 14.9 | -15.2 | -0.3 | 0.0 | 1.8 | 6.8 | -2.9 | -0.6 | -1.2 | 0.1 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



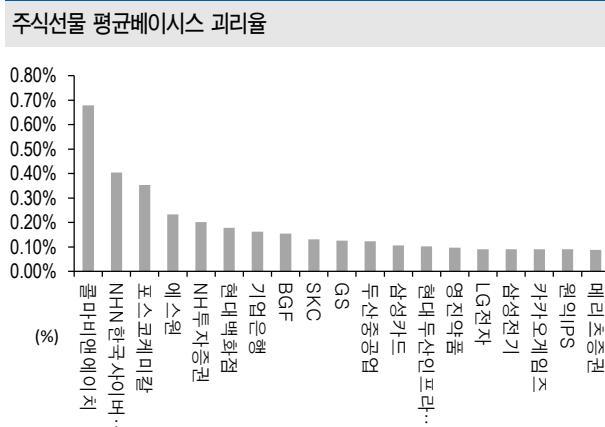
선물옵션시장 지표

| 지수옵션 시장동향 | | | | | | | | | (계약, 십억원) | | | | | | |
|-----------|------------|------|--------|---------|---------|---------|-------|-----|------------|-----------|--------|---------|-------|-----------------|-------|
| | 거래량 | | 거래대금 | | 미결제약정 | | 대표변동성 | | | 거래량 | | 거래대금 | | 미결제약정 | |
| Call | 1,927,095 | | 335.2 | | 461,555 | | 4.2% | | 지수옵션 전체 | 3,850,738 | | 638.2 | | 1,213,118 | |
| Put | 1,923,643 | | 303.1 | | 751,563 | | 19.7% | | PCR(금액기준) | 0.90 | | VKOSPI | | 25.71%(-3.24%p) | |
| | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 |
| Call | 357.5(K+3) | 0.02 | -0.29 | 571,594 | 0 | -18,565 | 3.6 | Put | 352.5(K+1) | 0.01 | -5.74 | 328,457 | 0 | -11,221 | 13.1 |
| | 355.0(K+2) | 0.74 | 0.04 | 238,833 | 0 | -19,016 | 2.9 | | 350.0(K+0) | 0.01 | -4.01 | 178,666 | 0 | -22,554 | 18.3 |
| | 352.5(K+1) | 3.08 | 1.71 | 33,227 | 0 | -11,244 | 0.3 | | 347.5(K-1) | 0.01 | -2.84 | 70,557 | 0 | -13,145 | 23.3 |
| | 350.0(K+0) | 5.56 | 3.35 | 10,048 | 0 | -7,250 | 15.1 | | 345.0(K-2) | 0.01 | -1.81 | 54,766 | 0 | -26,562 | 28.2 |
| | 347.5(K-1) | 7.97 | 4.47 | 3,838 | 0 | -2,186 | 0.2 | | 342.5(K-3) | 0.01 | -1.19 | 46,243 | 0 | -34,936 | 33.1 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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 | 5,001,452 | 3,474.5 | 3,605,746 | -1,740,008 | 75,322 | -62,506 | -13,596 | 2.4 | -16.5 | 13.9 | | |
| 종목명 | 선물현재가 (원) | 등락률 (%) | 선물거래대금 (십억원) | 선현배율 (%) | 미결제수량 (계약) | 미결제증감 (계약) | 평균괴리를 (%) | 외국인 순매수 | 개인 순매수 | 기관 순매수 | 금융투자 순매수 | 연기금등 순매수 |
| SK 하이닉스 | 119,500 | 2.14 | 275.7 | 58.7 | 0 | -144,286 | -0.25% | 3,114 | 843 | -3,955 | 4,566 | -4,256 |
| 셀트리온 | 171,500 | 1.18 | 36.9 | 35.0 | 0 | -20,724 | -0.10% | -343 | -3,629 | 3,957 | 6,224 | 0 |
| LG 이노텍 | 349,000 | 1.01 | 42.8 | 31.7 | 0 | -8,111 | -0.12% | -1,080 | 302 | 784 | 1,481 | -860 |
| 현대차 | 169,000 | 0.90 | 49.6 | 27.3 | 0 | -37,000 | -0.04% | -3,251 | 1,277 | 1,974 | 930 | 1,044 |
| 대한항공 | 27,800 | 2.96 | 13.0 | 23.6 | 0 | -42,803 | -0.03% | -1,951 | -1,711 | 3,264 | 47 | -1,228 |
| 삼성전기 | 156,500 | 0.32 | 30.9 | 22.7 | 0 | -24,263 | 0.09% | -4,511 | 7,626 | -3,114 | -967 | -5,141 |
| 하나금융지주 | 45,650 | 2.82 | 18.9 | 22.3 | 0 | -67,645 | -0.07% | 2,319 | -11,325 | 8,941 | 9,616 | -670 |
| 엔씨소프트 | 448,500 | 4.18 | 23.5 | 22.3 | 0 | -8,501 | -0.04% | 10 | 378 | -385 | 391 | -79 |
| 아모레퍼시픽 | 168,000 | -3.45 | 17.6 | 22.0 | 0 | -11,905 | 0.07% | 779 | 119 | -905 | 1,656 | 445 |
| LG 전자 | 119,500 | 1.27 | 21.1 | 20.2 | 0 | -25,544 | 0.09% | 291 | 353 | -584 | -328 | -237 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터