

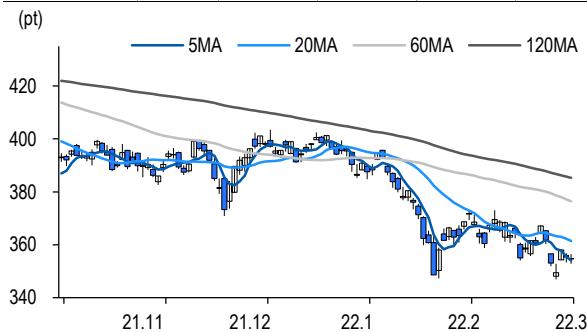


선물옵션시장 지표

2022.3.15

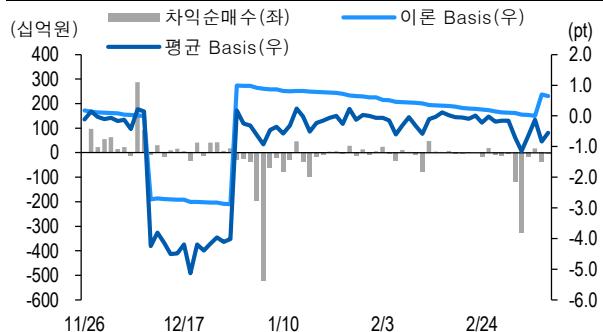
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	354.61	-0.20	-0.70	8,878.0	-
선물 6월물	354.00	-0.04	-0.15	18,603.8	245,643
선물 9월물	354.15	-0.07	-0.25	37.3	7,593
4월물(mini)	353.90	-0.07	-0.24	1,564.7	33,553
5월물(mini)	354.10	-0.21	-0.74	10.9	652



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.65	-0.55	-0.61	-0.34%
베이시스(mini)	-0.17	-0.72	-0.71	-0.16%
제1스프레드(SP)	0.32	0.08	0.10	-0.07%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.17	-0.79	-0.79	-0.18%



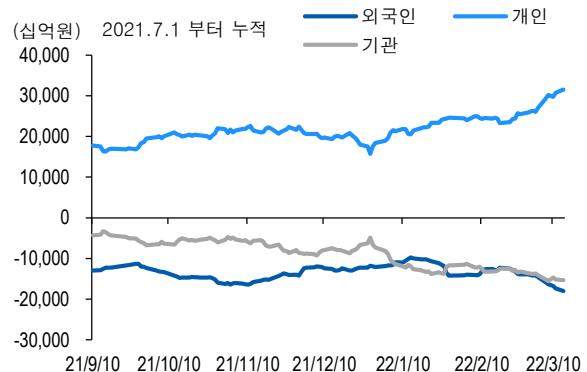
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-639.5	0.7	-638.7	0.0	-442.5	196.7	-2.5	-2.8	-0.2	-6.1
개인	625.0	102.8	727.8	0.0	4.6	-18.4	23.2	-0.7	-2.3	38.7
기관	5.3	-113.6	-108.3	-3.3	23.6	-160.2	-24.9	3.4	2.5	-32.9
금융투자	-16.8	-122.8	-139.6	-1.5	-0.8	-87.1	-24.1	3.4	0.7	28.0
투신	-35.6	-3.0	-38.6	0.0	-19.2	-79.1	-0.6	0.0	0.0	-30.1
은행+보험+기타금융	21.4	-0.9	20.5	0.0	15.6	-15.3	-0.2	0.0	1.8	0.0
연기금+국가지자체	81.7	2.6	84.3	-1.7	19.6	21.2	0.0	0.0	0.0	-30.7
기타법인	9.1	10.1	19.3	0.0	1.9	-18.1	4.1	0.1	0.0	0.2

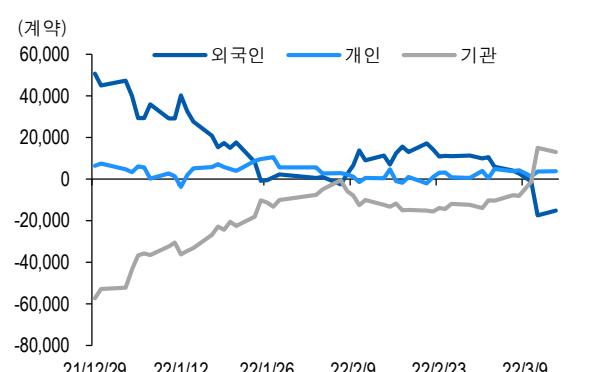
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	319,863	139.9	539,897	20.9%	지수옵션 전체	737,089	342.2	1,398,683
Put	417,226	202.4	858,786	24.0%	PCR(금액기준)	1.45	VKOSPI	24.70% (+0.29%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	362.5(K+3)	5.26	-0.41	4,249	2,662	234	20.5	357.5(K+1)
	360.0(K+2)	6.36	-0.40	5,532	3,746	436	21.0	355.0(K+0)
	357.5(K+1)	7.46	-0.49	3,272	2,265	37	21.2	352.5(K-1)
	355.0(K+0)	8.82	-0.37	3,745	3,679	971	21.7	350.0(K-2)
	352.5(K-1)	10.20	-0.40	1,589	1,396	279	22.0	347.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	357.5(K+1)	11.20	-0.10	642	1,156	24	22.9	355.0(K+0)
	355.0(K+0)	10.00	-0.10	3,450	4,486	689	23.3	352.5(K-1)
	352.5(K-1)	8.92	-0.12	3,984	3,396	623	23.7	350.0(K-2)
	350.0(K-2)	7.86	-0.18	4,069	8,106	942	23.9	347.5(K-3)
	347.5(K-3)	6.99	-0.21	3,856	2,777	-101	24.4	

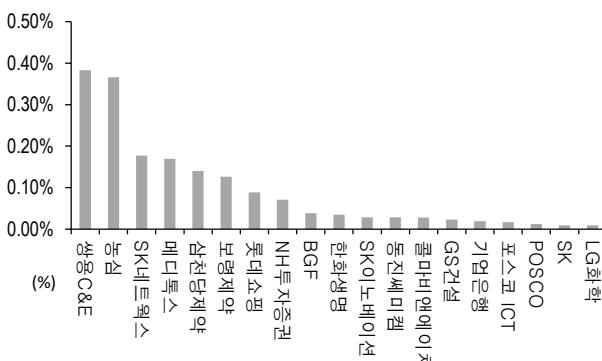
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,527,201	2,611.9	4,069,195	77,516	-76,692	50,825	25,746	-6.1	38.7	-32.9
<hr/>										
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
대한항공	28,650	0.00	24.0	60.4	69,464	3,213	-0.21%	624	3,888	-4,513
대상	21,850	0.00	1.2	59.7	6,321	1,203	-0.03%	-1,249	1,771	-522
일진머티리얼즈	82,700	-2.93	18.2	57.9	106,704	-1,335	-0.23%	3,304	-5,169	1,863
POSCO	285,000	1.79	46.0	57.7	18,433	1,072	0.01%	-528	161	367
하나금융지주	46,350	-0.32	31.0	57.2	83,604	-7,755	-0.14%	-489	1,773	-984
SK 하이닉스	116,500	-0.43	201.3	55.2	154,445	5,521	-0.21%	6,383	17,082	-23,618
셀트리온	180,500	4.64	145.5	55.1	43,988	4,131	-0.29%	-1,962	3,234	-1,245
삼성 SDI	489,500	1.66	165.5	54.0	22,680	590	-0.04%	290	1,295	-1,630
현대제철	39,600	1.02	11.0	52.8	12,588	-100	-0.10%	-3,069	1,953	1,116
현대차	165,000	-2.08	94.9	52.1	49,429	2,366	-0.15%	1,694	1,154	-2,848

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터