

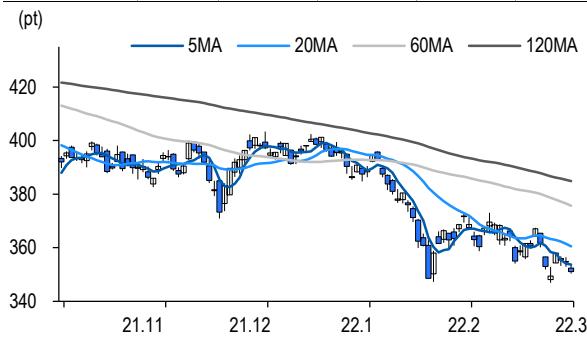


## 선물옵션시장 지표

2022.3.16

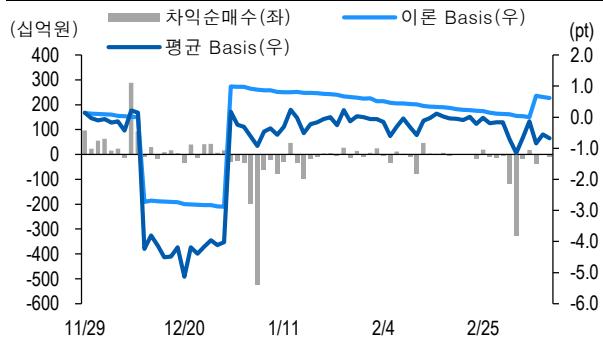
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	351.03	-1.01	-3.58	7,049.1	-
선물 6월물	350.30	-1.05	-3.70	20,454.6	251,007
선물 9월물	350.25	-1.10	-3.90	22.2	7,562
4월물(mini)	350.42	-0.98	-3.48	1,632.9	36,783
5월물(mini)	350.44	-1.03	-3.66	10.3	697



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.62	-0.68	-0.73	-0.37%
베이시스(mini)	-0.19	-0.80	-0.61	-0.17%
제1스프레드(SP)	0.31	0.06	0.10	-0.07%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.19	-0.73	-0.73	-0.16%



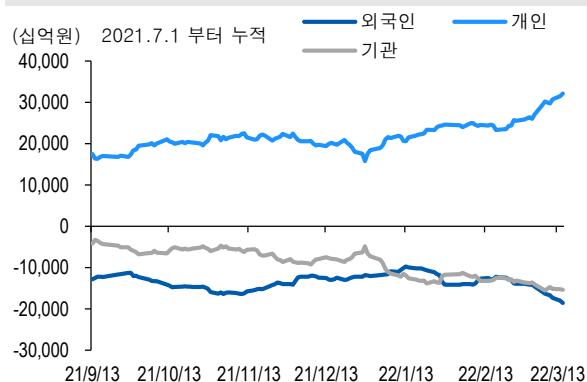
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

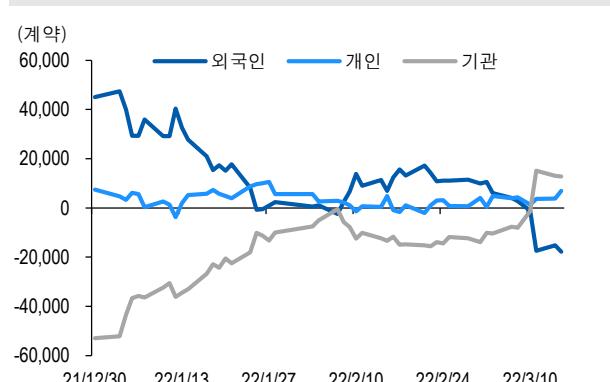
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-673.3	89.1	-584.2	-7.1	-572.4	-230.8	-6.6	-1.0	2.6	-13.9
개인	605.0	55.3	660.3	0.0	1.7	238.5	35.2	-0.2	-1.2	32.3
기관	39.5	-151.0	-111.5	-3.1	14.2	8.8	-31.8	1.2	-0.9	-18.7
금융투자	-29.6	-175.8	-205.3	-8.4	-7.0	234.5	-29.5	1.6	-1.0	1.1
투신	-9.9	1.0	-8.9	0.0	7.1	-241.1	-2.2	0.0	0.0	1.7
은행+보험+기타금융	5.9	7.3	13.2	0.0	-5.3	20.5	0.0	-0.5	0.1	-0.1
연기금+국가지자체	106.0	0.9	106.9	5.3	29.9	-5.0	0.0	0.0	0.0	-21.5
기타법인	28.8	6.6	35.4	0.0	0.1	-16.5	3.1	0.0	-0.5	0.4

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	370,786	151.9	569,494	21.4%	지수옵션 전체	822,400	368.3	1,472,269							
Put	451,614	216.4	902,775	24.2%	PCR(금액기준)	1.42	VKOSPI	25.77%(+1.07%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	362.5(K+3)	4.13	-1.13	5,289	2,959	297	21.1	Put	357.5(K+1)	13.20	2.00	286	1,163	7	23.2
	360.0(K+2)	5.04	-1.32	7,331	4,357	611	21.5		355.0(K+0)	11.90	1.90	1,120	4,484	-2	23.7
	357.5(K+1)	6.06	-1.40	5,368	2,624	359	21.9		352.5(K-1)	10.65	1.73	3,471	3,689	293	24.0
	355.0(K+0)	7.20	-1.62	3,561	4,209	530	22.2		350.0(K-2)	9.42	1.56	4,039	8,180	74	24.2
	352.5(K-1)	8.43	-1.77	2,418	1,897	501	22.6		347.5(K-3)	8.38	1.39	2,772	2,969	192	24.6

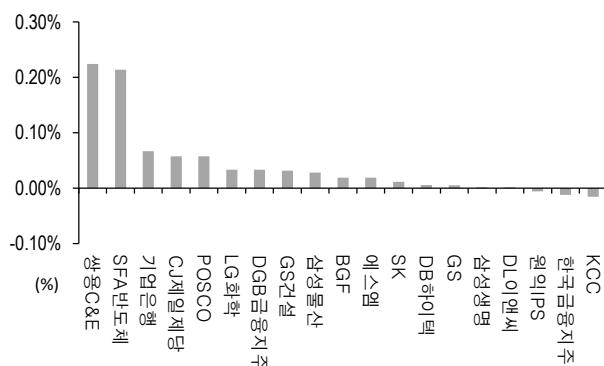
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	3,352,437	2,096.2	4,231,857	162,662	-34,431	36,801	-2,648	-13.9	32.3	-18.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전기	151,000	-1.31	41.8	77.2	42,154	-303	-0.05%	1,764	-97	-1,679
GS 건설	47,200	-2.07	36.1	74.9	58,159	2,557	0.03%	331	3,546	-3,877
현대제철	38,650	-2.40	13.9	71.1	19,289	6,701	-0.03%	-2,907	-946	3,853
카카오	102,500	-0.97	125.3	68.9	88,441	5,257	-0.38%	487	4,565	-5,053
LG 이노텍	341,500	0.59	65.1	66.7	11,275	-337	-0.06%	-307	270	34
대상	21,900	0.23	0.8	62.9	6,340	19	-0.05%	130	-41	-89
일진미터리얼즈	82,900	0.24	11.3	61.1	104,963	-1,741	-0.31%	11	-2,474	2,463
현대차	162,500	-1.52	86.4	60.5	51,176	1,747	-0.04%	3,462	1,487	-4,963
삼성생명	59,800	-0.50	6.8	59.1	32,320	3,433	0.00%	-3,324	3,657	-370
삼성 SDI	486,500	-0.61	74.7	57.4	22,359	-321	-0.10%	-226	-47	266

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터