

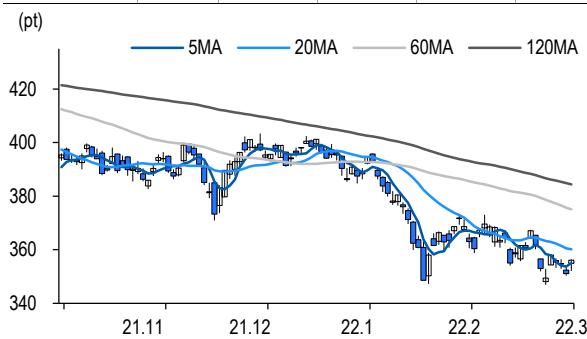


선물옵션시장 지표

2022.3.17

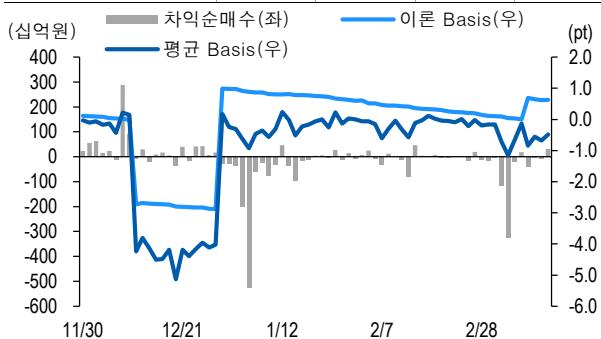
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	356.09	1.44	5.06	6,290.0	-
선물 6월물	356.10	1.66	5.80	20,258.9	246,458
선물 9월물	356.20	1.70	5.95	28.5	7,585
4월물(mini)	355.94	1.58	5.52	1,632.9	38,172
5월물(mini)	355.68	1.50	5.24	6.9	698



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.62	-0.48	0.01	-0.31%
베이시스(mini)	-0.19	-0.58	-0.15	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.32	0.10	0.10	-0.06%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.19	-0.54	-0.54	-0.10%



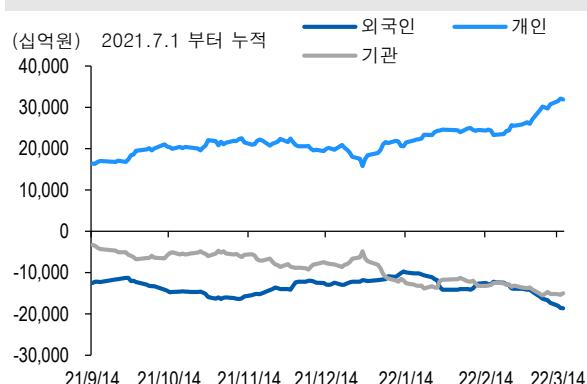
투자주체별 매매 동향

(십억원)

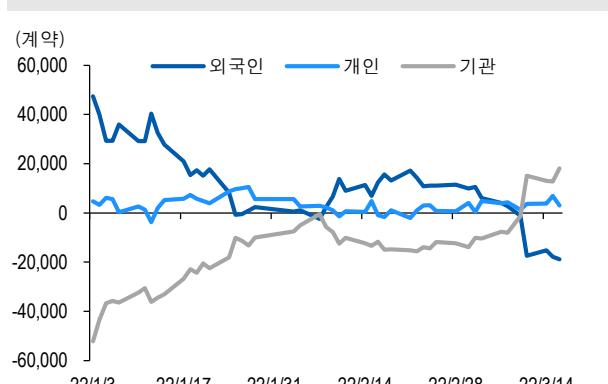
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-134.2	52.4	-81.8	5.9	69.8	-129.2	38.5	-0.4	0.1	-0.4
개인	-236.1	-27.9	-264.0	0.0	4.4	-280.1	-58.7	-1.1	-1.5	25.0
기관	365.6	-23.2	342.4	24.8	-33.7	454.5	25.2	1.9	1.4	-24.1
금융투자	273.7	-29.4	244.3	-1.8	-5.6	-118.4	25.0	1.9	2.0	-16.2
투신	-2.0	9.3	7.3	0.0	-10.2	645.7	0.2	-0.1	0.0	12.8
은행+보험+기타금융	-13.2	6.0	-7.2	0.0	-5.3	-47.5	0.0	0.0	-0.6	-0.9
연기금+국가지자체	55.3	-7.7	47.6	26.5	-10.2	-25.3	0.0	0.0	0.0	-19.9
기타법인	4.8	-1.3	3.5	0.0	-1.0	-45.2	-4.9	-0.4	-0.1	-0.5

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	408,782	173.8	593,444	21.4%	지수옵션 전체	857,386	370.4	1,522,129
Put	448,604	196.7	928,685	23.6%	PCR(금액기준)	1.13	VKOSPI	23.74%(-2.03%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	357.5(K+3)	7.92	1.86	4,750	3,008	384	21.3	352.5(K+1)
	355.0(K+2)	9.34	2.14	4,428	4,668	459	21.9	350.0(K+0)
	352.5(K+1)	10.85	2.42	1,703	2,006	109	22.3	347.5(K-1)
	350.0(K+0)	12.10	2.32	539	3,861	42	21.9	345.0(K-2)
	347.5(K-1)	14.00	2.65	217	723	69	22.9	342.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	352.5(K+1)	7.48	-3.17	3,743	4,134	445	22.5	350.0(K+0)
	350.0(K+0)	6.55	-2.87	3,917	9,313	1,133	22.8	347.5(K-1)
	347.5(K-1)	5.73	-2.65	4,039	3,242	273	23.2	345.0(K-2)
	345.0(K-2)	5.01	-2.43	5,218	5,794	294	23.7	342.5(K-3)
	342.5(K-3)	4.41	-2.22	9,009	2,611	740	24.2	

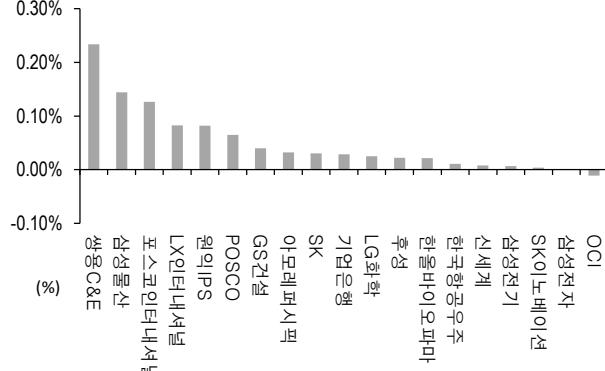
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,894,992	2,093.6	4,280,489	48,632	-5,667	7,143	-558	-0.4	25.0	-24.1
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	39,000	0.91	11.3	82.0	13,526	-5,763	-0.10%	761	2,779	-3,540
현대차	168,000	3.38	100.7	70.1	50,638	-538	-0.08%	-830	-664	1,494
SK 하이닉스	116,000	3.57	298.6	69.4	169,107	288	-0.42%	2,654	-1,490	-1,108
카카오	104,000	1.46	112.4	62.0	89,344	903	-0.40%	-3,196	1,795	1,401
GS 건설	47,400	0.42	18.3	57.4	61,578	3,419	0.04%	-2,290	4,043	-1,783
LG 전자	125,000	1.63	55.0	57.0	25,400	614	-0.20%	-1,043	253	1,190
삼성전기	156,000	3.31	47.8	56.7	41,248	-906	0.01%	443	1,376	-1,819
포스코케미칼	98,100	2.08	16.5	56.3	10,640	-155	-0.09%	464	-73	-392
롯데케미칼	206,000	2.49	15.5	53.9	4,698	27	-0.19%	-544	8	536
삼성전자	70,200	1.30	378.1	53.4	1,033,466	13,659	0.00%	4,609	6,153	-10,733

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터