

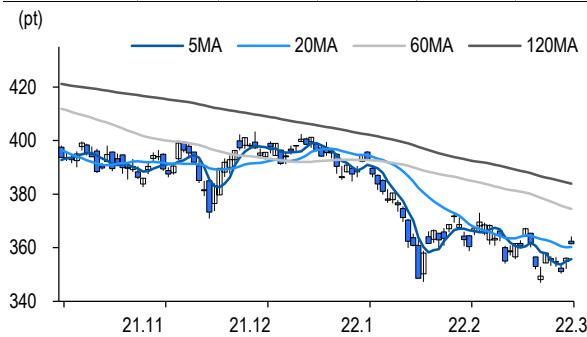


선물옵션시장 지표

2022.3.18

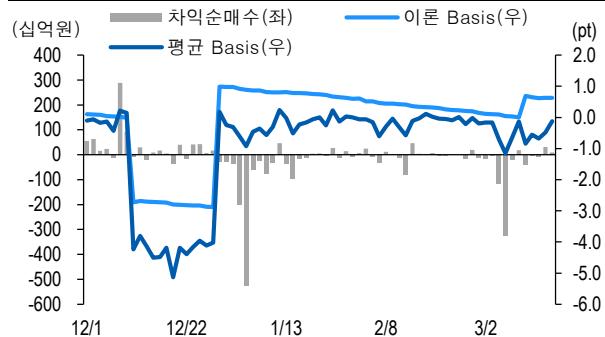
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	361.46	1.51	5.37	8,967.6	-
선물 6월물	361.75	1.59	5.65	23,281.5	243,821
선물 9월물	361.75	1.56	5.55	42.2	7,647
4월물(mini)	361.20	1.48	5.26	2,127.0	49,271
5월물(mini)	360.02	1.22	4.34	6.8	835



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.63	-0.12	0.29	-0.21%
베이시스(mini)	-0.20	-0.41	-0.26	-0.06%
제1스프레드(SP)	0.35	0.06	0.05	-0.08%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.20	-0.41	-0.41	-0.06%



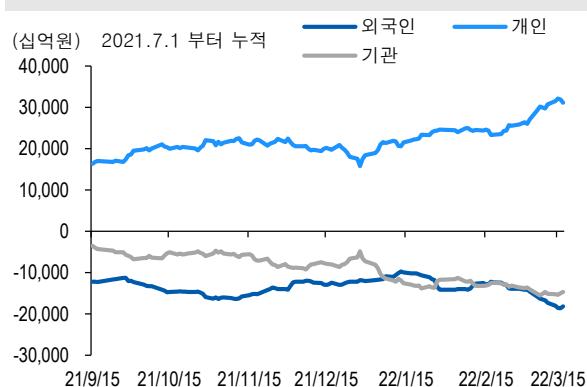
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	463.6	27.3	490.9	9.7	652.7	-93.1	-186.1	6.3	-19.6	15.1
개인	-694.7	-105.6	-800.3	0.0	2.8	71.5	14.4	-4.1	21.3	-79.8
기관	250.0	70.7	320.6	-0.6	1.2	60.3	168.4	-1.9	-1.4	64.7
금융투자	196.4	110.0	306.4	3.0	2.2	-133.2	165.7	-2.4	-1.1	14.2
투신	30.3	4.0	34.3	0.0	-0.4	154.4	2.8	-0.1	-0.1	43.1
은행+보험+기타금융	26.1	-24.4	1.7	0.0	-2.0	16.1	-0.1	0.5	-0.2	0.1
연기금+국가지자체	-30.4	-9.1	-39.4	-3.6	-1.8	23.0	0.0	0.0	0.0	7.3
기타법인	-18.9	7.6	-11.2	0.0	0.3	-38.7	3.4	-0.2	-0.4	0.0

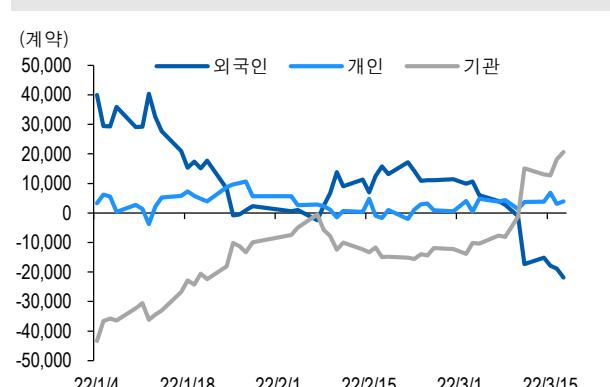
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

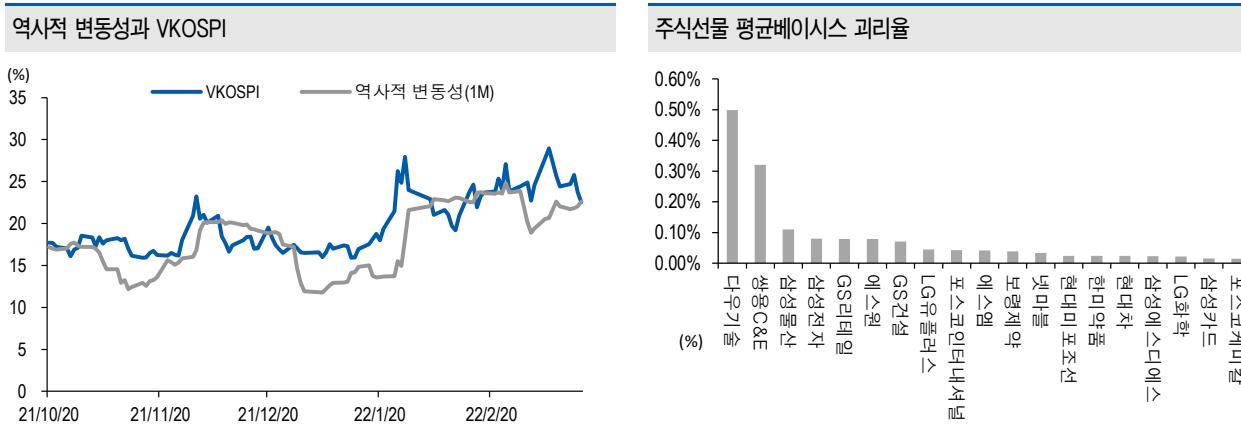
투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	606,889	281.1	620,323	20.3%	지수옵션 전체		1,346,585	581.3	1,648,416		
Put	739,696	300.2	1,028,093	22.5%	PCR(금액기준)		1.07	VKOSPI	22.55%(-1.19%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	362.5(K+3)	7.61	2.06	8,972	5,159	2,076	20.2	357.5(K+1)	6.78	-2.87	5,377
	360.0(K+2)	9.07	2.35	3,357	4,757	222	20.8	355.0(K+0)	5.95	-2.58	10,796
	357.5(K+1)	10.60	2.68	1,756	2,368	-640	21.3	352.5(K-1)	5.20	-2.28	9,106
	355.0(K+0)	12.00	2.66	1,005	4,481	-187	21.1	350.0(K-2)	4.65	-1.90	40,556
	352.5(K-1)	13.70	2.85	315	1,920	-86	21.5	347.5(K-3)	3.93	-1.80	27,813
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	357.5(K+1)	6.78	-2.87	5,377	2,066	731	21.1	355.0(K+0)	5.95	-2.58	10,796
	355.0(K+0)	5.95	-2.58	10,796	5,811	878	21.7	352.5(K-1)	5.20	-2.28	9,106
	352.5(K-1)	5.20	-2.28	9,106	5,838	1,704	22.2	350.0(K-2)	4.65	-1.90	40,556
	350.0(K-2)	4.65	-1.90	40,556	27,813	18,500	23.1	347.5(K-3)	3.93	-1.80	27,813
	347.5(K-3)	3.93	-1.80	16,602	4,931	1,689	23.2	347.5(K-3)	3.93	-1.80	16,602

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

자료: KRX, 유인타증권 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	3,463,048	2,789.6	4,301,423	20,934	25,143	-33,670	7,911	15.1	-79.8	64.7		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	124,000	6.90	552.7	62.4	172,553	3,446	-0.64%	9,206	-83,215	74,259	68,450	6,106
현대차	169,000	0.60	94.0	58.6	50,688	50	0.02%	-2,842	1,885	797	-695	-1,981
삼성전기	160,000	2.56	66.3	50.0	39,209	-2,039	-0.01%	2,424	-156	-2,343	-5,404	-475
일진마티리얼즈	86,700	3.21	10.9	49.2	105,013	671	-0.04%	630	1,665	-2,315	-1,352	-1,013
LG 이노텍	370,500	2.21	74.9	48.8	11,576	234	-0.06%	-301	198	90	423	-233
LG 화학	472,000	6.07	157.5	48.4	13,444	-958	0.02%	125	-1,049	908	-240	887
SK	236,000	0.43	13.6	48.3	4,864	-587	-0.03%	-525	-35	560	-592	1,152
CJ	80,700	-0.37	2.0	47.0	6,971	-201	-0.20%	-448	-9	457	457	0
POSCO 홀딩스	281,500	0.54	29.9	46.6	18,173	-1,428	-0.08%	229	508	-737	899	440
카카오	106,500	2.40	170.9	45.5	92,429	3,085	-0.31%	2,277	-1,607	-685	1,906	-2,520

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터