

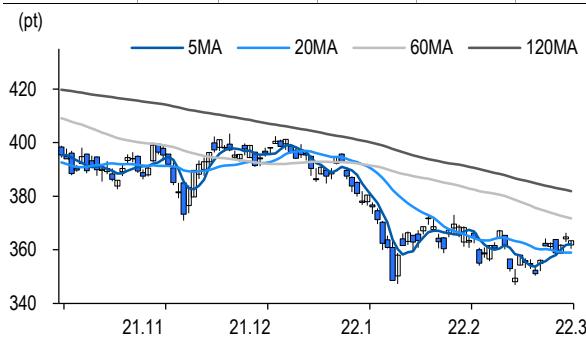


선물옵션시장 지표

2022.3.25

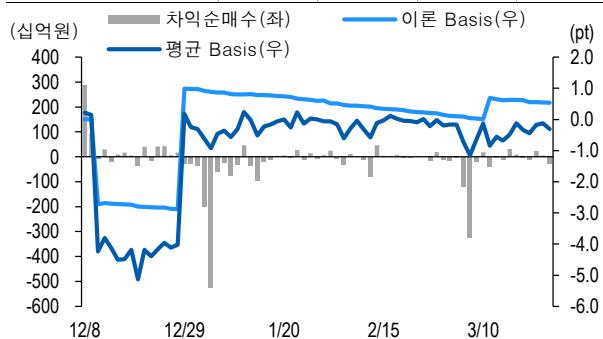
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	363.38	-0.40	-1.46	6,910.2	-
선물 6월물	362.50	-0.48	-1.75	18,217.3	253,481
선물 9월물	362.80	-0.41	-1.50	20.8	7,930
4월물(mini)	362.22	-0.43	-1.58	1,537.5	61,747
5월물(mini)	362.90	-0.39	-1.42	5.5	1,432



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.54	-0.31	-0.88	-0.23%
베이시스(mini)	-0.30	-0.68	-1.16	-0.10%
제1스프레드(SP)	0.36	0.08	0.05	-0.08%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.30	-1.23	-1.23	-0.26%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-482.3	66.7	-415.6	-1.0	-308.9	-217.2	36.3	-1.7	4.5	20.4
개인	682.9	49.9	732.7	0.0	-1.8	145.1	36.1	0.5	-1.9	43.0
기관	-222.4	-122.6	-345.1	-27.2	13.2	15.3	-69.3	1.3	-2.2	-64.2
금융투자	-184.0	-91.7	-275.7	-1.8	0.3	190.1	-70.1	1.5	-2.1	-49.6
투신	6.4	-35.7	-29.4	0.0	-3.9	-218.7	0.6	-0.1	0.0	-21.1
은행+보험+기타금융	-7.0	0.2	-6.8	0.0	0.3	23.4	0.1	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-25.9	0.3	-25.6	-25.4	21.1	20.5	0.0	0.0	0.0	6.5
기타법인	21.9	6.0	27.9	0.0	0.1	56.8	-3.0	0.0	-0.5	0.8

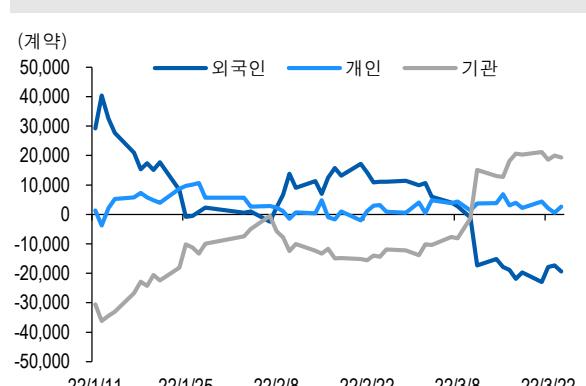
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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
Call	428,931	149.1	710,679	15.2%	지수옵션 전체	1,012,155	341.1
Put	583,224	192.0	1,197,286	19.1%	PCR(금액기준)	1.29	VKOSPI 19.73%(+0.12%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	372.5(K+3)	1.97	-0.57	41,386	12,218	1,059	15.1	Put	367.5(K+1)	8.56	0.44	289	1,474	-1	17.1
	370.0(K+2)	2.75	-0.65	45,955	15,972	2,122	15.4		365.0(K+0)	7.59	0.76	3,499	4,702	-308	18.5
	367.5(K+1)	3.58	-0.87	19,057	7,683	636	15.4		362.5(K-1)	6.34	0.60	5,440	5,380	276	18.7
	365.0(K+0)	4.74	-0.94	13,419	8,007	-117	15.8		360.0(K-2)	5.26	0.43	8,411	10,493	977	18.9
	362.5(K-1)	5.94	-1.12	7,581	7,266	419	15.9		357.5(K-3)	4.37	0.34	6,135	3,662	-12	19.3

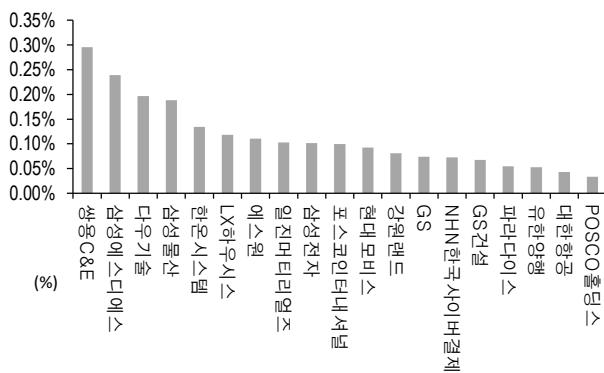
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



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	2,995,895	2,200.1	4,525,087	124,545	27,419	82,278	-112,275	20.4	43.0	-64.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK 하이닉스	120,500	-2.03	309.7	62.0	176,840	2,804	-0.25%	-2,050	2,513	-497
삼성전기	166,000	-0.30	39.4	60.5	32,419	-1,123	-0.06%	308	-62	-246
카카오	104,500	-2.34	128.7	59.9	91,577	2,127	-0.37%	-415	8,225	-7,713
GS 건설	47,600	0.42	16.2	58.7	70,395	-596	0.07%	-705	-1,361	2,066
현대차	176,000	0.28	71.7	58.0	46,474	106	-0.10%	850	3	-792
LG 이노텍	406,500	1.75	61.3	53.1	15,426	249	0.01%	-40	395	-303
하나금융지주	49,650	0.51	25.3	52.8	83,041	-988	-0.06%	-2,853	-639	3,491
CJ	83,100	-0.48	1.4	48.2	7,161	-182	-0.07%	14	101	-115
LG 전자	121,500	-1.22	42.1	47.2	33,133	3,209	-0.12%	969	-3,853	2,984
한국전력	23,100	-0.22	16.9	42.4	255,430	3,255	0.02%	933	3,958	-4,891

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터