

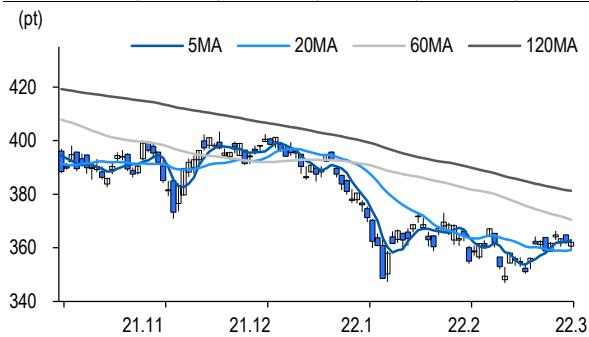


선물옵션시장 지표

2022.3.29

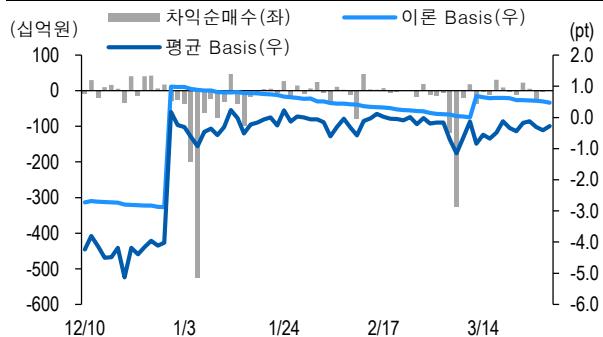
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	362.06	0.00	0.00	5,890.6	-
선물 6월물	362.45	0.19	0.70	17,252.9	254,046
선물 9월물	362.60	0.21	0.75	35.9	8,116
4월물(mini)	362.06	0.18	0.64	1,287.5	64,327
5월물(mini)	362.06	0.16	0.58	9.0	1,509



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.47	-0.28	0.39	-0.21%
베이시스(mini)	-0.36	-0.63	0.00	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.35	0.05	0.05	-0.08%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.36	0.01	0.01	0.10%



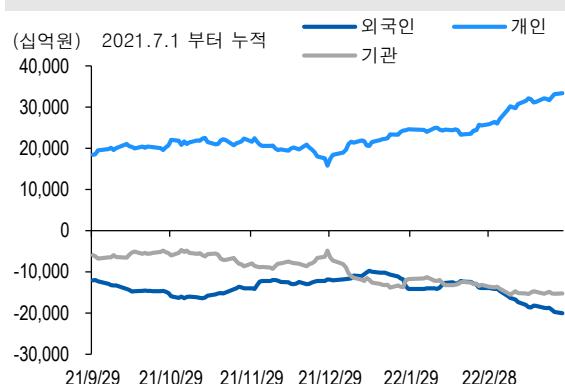
투자주체별 매매 동향

(십억원)

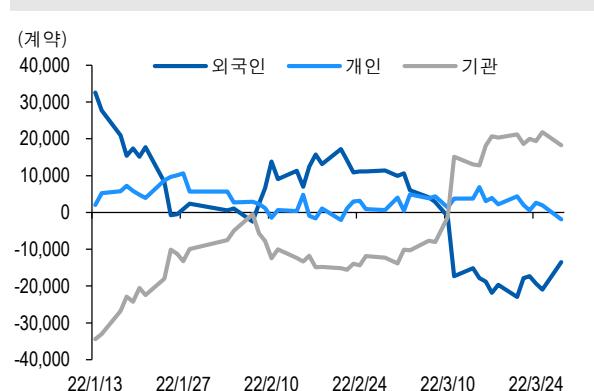
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-262.8	-64.8	-327.7	-2.9	-41.3	613.5	65.8	-0.1	-2.4	13.7
개인	192.1	60.3	252.4	0.0	2.6	-306.9	-40.4	-1.6	1.1	-3.8
기관	67.6	6.7	74.3	4.1	-17.3	-296.2	-25.6	1.9	1.4	-8.6
금융투자	138.2	-8.1	130.1	-8.7	0.2	-358.3	-27.8	1.8	0.9	2.6
투신	-22.4	46.7	24.3	0.0	-12.6	79.5	2.3	0.0	0.0	-11.0
은행+보험+기타금융	-16.0	-29.4	-45.3	0.0	-2.7	5.4	-0.1	0.0	0.5	4.8
연기금+국가지자체	3.6	-0.7	2.9	12.8	0.5	-22.8	0.0	0.0	0.0	-5.0
기타법인	3.1	-2.2	0.9	0.0	0.7	-10.4	0.2	-0.2	-0.1	-1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

(계약, 십억원)									
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정	
Call	605,417	218.7	743,375	16.6%	지수옵션 전체		1,300,777	431.0	1,971,795
Put	695,360	212.4	1,228,420	18.1%	PCR(금액기준)		0.97	VKOSPI	19.60%(-0.02%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	370.0(K+3)	2.18	-0.09	77,086	18,584	793	16.4	365.0(K+1)	6.90
	367.5(K+2)	2.99	-0.11	59,292	9,173	1,284	16.7	362.5(K+0)	5.77
	365.0(K+1)	4.05	-0.03	27,545	8,809	219	17.2	360.0(K-1)	4.74
	362.5(K+0)	5.34	0.08	12,459	7,909	374	17.8	357.5(K-2)	3.85
	360.0(K-1)	6.80	0.08	5,492	6,483	502	18.5	355.0(K-3)	3.08
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	365.0(K+1)	6.90	-0.77	2,425	4,363	-91	15.8	362.5(K+0)	5.77
	362.5(K+0)	5.77	-0.59	5,661	6,057	1,019	16.8	360.0(K-1)	4.74
	360.0(K-1)	4.74	-0.53	8,227	10,840	463	17.4	357.5(K-2)	3.85
	357.5(K-2)	3.85	-0.52	8,137	4,424	142	17.9	355.0(K-3)	3.08
	355.0(K-3)	3.08	-0.50	21,722	8,228	-429	18.4		

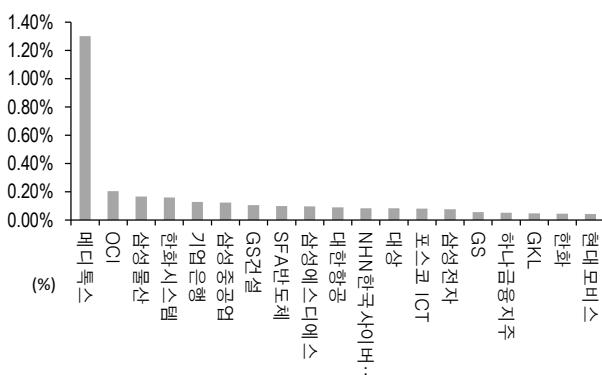
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,384,610	1,755.0	4,613,208	61,962	-21,625	31,795	-10,571	13.7	-3.8	-8.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK 하이닉스	118,500	0.85	258.3	67.6	183,457	-2,080	-0.28%	3,818	4,093	-7,701
GS 건설	47,500	1.17	14.3	65.7	66,658	-3,202	0.11%	-1,597	1,607	-10
카카오	105,000	0.00	93.3	58.5	93,219	3,196	-0.06%	2,241	185	-2,446
현대차	174,500	0.58	45.4	56.8	46,798	-54	-0.01%	332	229	-761
LG 화학	524,000	-0.57	51.6	53.3	11,087	316	-0.01%	561	-550	-12
POSCO 홀딩스	296,500	0.00	39.0	49.3	21,721	-264	0.00%	658	-681	6
삼성전자	69,500	-0.14	417.6	47.6	1,112,591	2,996	0.08%	960	-2,491	2,301
하나금융지주	49,250	-0.30	20.1	46.9	87,031	4,032	0.05%	2,590	3,596	-6,281
LG 이노텍	391,500	-2.73	74.0	46.3	15,349	-90	-0.01%	-395	-517	1,175
삼성전기	163,500	-0.61	21.8	44.9	32,920	124	-0.06%	1,496	-306	-1,190

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터