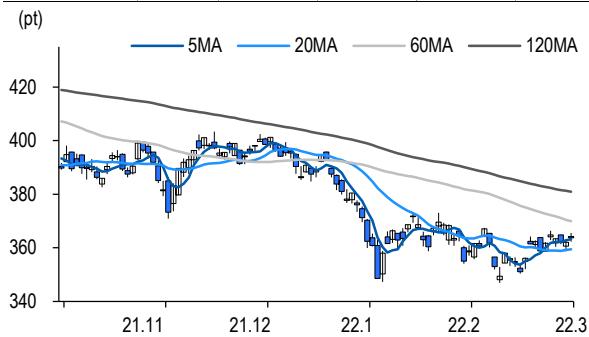


선물옵션시장 지표

2022.3.30

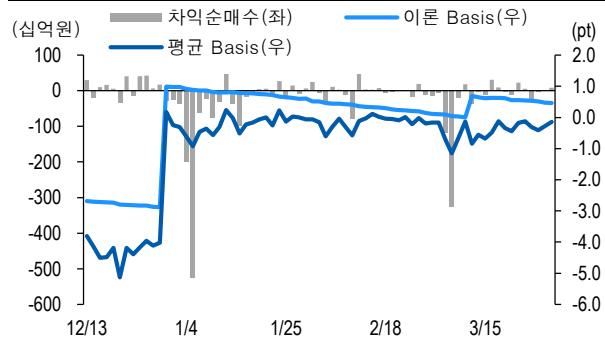
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	363.77	0.47	1.71	6,098.4	-
선물 6월물	363.55	0.30	1.10	16,081.5	252,202
선물 9월물	363.65	0.29	1.05	41.8	8,689
4월물(mini)	363.10	0.29	1.04	1,317.6	67,125
5월물(mini)	363.22	0.32	1.16	10.6	1,643



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.46	-0.14	-0.22	-0.17%
베이시스(mini)	-0.38	-0.54	-0.67	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.36	0.05	0.05	-0.09%
합성선물 베이시스(ATM)	-0.38	-0.68	-0.68	-0.08%



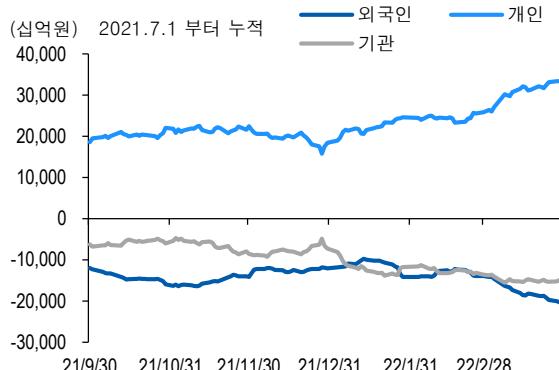
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-280.1	36.0	-244.1	0.7	-63.6	-166.1	-118.9	-5.4	4.3	8.6
개인	-8.4	-9.3	-17.7	0.0	2.4	199.7	7.9	1.9	-1.5	18.3
기관	326.7	-0.3	326.4	7.5	-44.8	46.0	107.9	2.6	-3.4	-27.3
금융투자	425.5	23.5	449.0	7.4	-1.7	7.7	107.5	2.7	-1.2	-49.2
투신	-44.5	4.7	-39.8	0.0	-34.9	-11.0	0.0	0.0	0.0	16.7
은행+보험+기타금융	-22.2	-42.7	-64.8	0.0	-2.5	51.8	0.4	0.0	-2.2	-0.2
연기금+국가지자체	-34.2	13.1	-21.1	0.1	-6.7	-2.5	0.0	0.0	0.0	5.3
기타법인	-38.2	-26.4	-64.5	0.0	0.7	-79.7	3.1	0.8	0.6	0.4

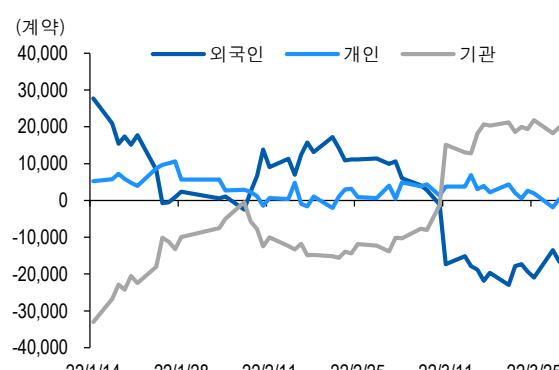
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	611,712	179.4	773,140	15.0%	지수옵션 전체		1,309,133	358.1	2,025,550		
Put	697,421	178.7	1,252,410	18.1%	PCR(금액기준)		1.00	VKOSPI	18.75%(-0.85%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	370.0(K+3)	2.13	-0.05	76,196	20,953	2,369	14.9	365.0(K+1)	6.02	-0.88	3,926
	367.5(K+2)	3.05	0.06	26,425	9,477	304	15.3	362.5(K+0)	4.89	-0.88	7,314
	365.0(K+1)	4.17	0.12	17,254	9,553	744	15.7	360.0(K-1)	3.90	-0.84	13,290
	362.5(K+0)	5.48	0.14	10,044	9,412	1,503	16.0	357.5(K-2)	3.07	-0.78	17,534
	360.0(K-1)	7.00	0.20	2,784	6,523	40	16.4	355.0(K-3)	2.41	-0.67	33,461
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	365.0(K+1)	6.02	-0.88	3,926	4,678	315	16.6	362.5(K+0)	4.89	-0.88	7,314
	362.5(K+0)	4.89	-0.88	7,314	7,963	1,906	17.1	360.0(K-1)	3.90	-0.84	13,290
	360.0(K-1)	3.90	-0.84	13,290	11,687	847	17.5	357.5(K-2)	3.07	-0.78	17,534
	357.5(K-2)	3.07	-0.78	17,534	5,453	1,029	17.8	355.0(K-3)	2.41	-0.67	33,461
	355.0(K-3)	2.41	-0.67	33,461	9,817	1,589	18.3				

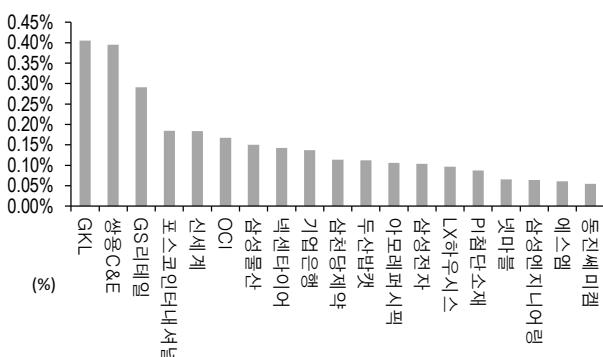
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)	금융투자	연기금등	순매수
주식선물 전체	2,816,554	2,007.3	4,686,981	73,773	-27,117	-256	28,777	8.6	18.3	-27.3			
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수	
SK 하이닉스	120,000	1.27	302.5	77.5	207,536	24,079	-0.27%	6,566	4,633	-11,364	-21,968	1,149	
현대차	176,500	1.15	70.4	73.7	47,319	521	0.01%	239	1,454	-1,693	909	-1,352	
하나금융지주	49,000	-0.51	23.8	67.0	87,667	636	0.04%	273	-1,071	834	-366	1,204	
엔씨소프트	463,000	1.31	21.7	65.3	8,887	-2	-0.03%	-179	-100	279	-4	-372	
LG 이노텍	391,500	0.00	94.2	56.9	14,632	-717	0.00%	761	644	-1,692	90	-377	
삼성전자	69,800	0.43	512.4	53.6	1,119,901	7,310	0.10%	-4,937	2,031	3,904	-15,752	11,450	
LG 화학	524,000	0.00	37.9	49.9	10,749	-338	0.04%	-267	75	192	-1	193	
GS건설	46,000	-3.16	19.7	48.6	59,958	-6,700	0.04%	1,851	1,485	-2,986	2,916	529	
NAVER	335,000	0.75	50.8	47.1	28,265	-229	0.04%	-307	-297	686	-279	226	
카카오	105,000	0.00	64.1	46.2	97,056	3,837	-0.14%	2,189	1,231	-3,350	-1,913	-1,771	

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터