

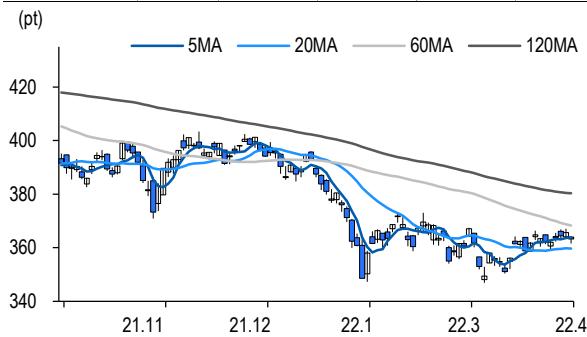


선물옵션시장 지표

2022.4.4

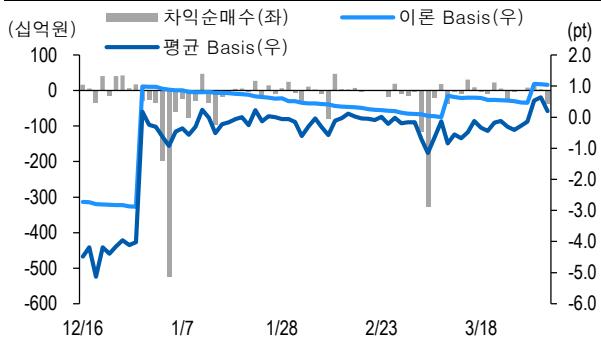
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	363.19	-0.66	-2.42	7,120.6	-
선물 6월물	363.50	-0.60	-2.20	15,988.9	253,026
선물 9월물	363.55	-0.60	-2.20	37.0	9,114
4월물(mini)	363.18	-0.56	-2.04	1,282.1	79,080
5월물(mini)	363.38	-0.56	-2.04	12.7	2,051



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.04	0.20	0.31	-0.23%
베이시스(mini)	0.20	-0.11	-0.01	-0.08%
제1스프레드(SP)	0.36	0.00	0.00	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.20	0.11	0.11	-0.02%



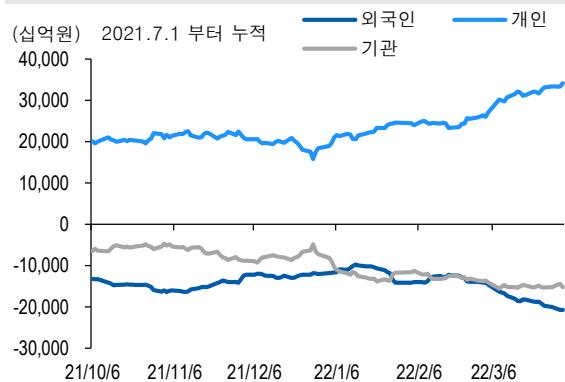
투자주체별 매매 동향

(십억원)

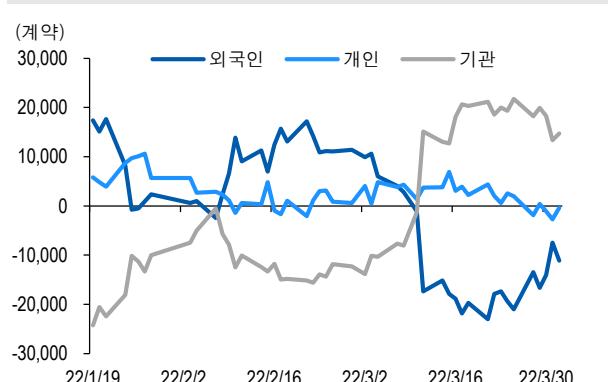
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-68.0	4.0	-64.0	-3.7	37.3	-505.8	175.8	2.5	-0.5	-17.3
개인	845.7	-29.6	816.1	0.0	-4.7	225.1	-7.2	-0.7	-1.0	39.6
기관	-782.7	20.7	-762.0	-33.4	14.8	290.3	-167.5	-1.9	1.7	-22.5
금융투자	-609.2	-1.2	-610.4	-9.5	-1.6	690.9	-167.0	-1.8	2.0	-2.9
투신	-24.4	6.2	-18.1	0.0	6.7	-414.8	-0.3	-0.2	0.0	-39.4
은행+보험+기타금융	-10.0	6.7	-3.3	0.0	-2.4	-25.6	-0.1	0.1	-0.2	-0.1
연기금+국가지자체	-114.6	2.6	-112.0	-23.9	9.7	39.9	0.0	0.0	0.0	19.8
기타법인	5.0	4.9	10.0	0.0	-0.3	-9.6	-1.0	0.1	-0.3	0.1

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	598,966	137.3	821,749	13.5%	지수옵션 전체	1,363,086	339.3	2,172,812
Put	764,120	202.0	1,351,063	15.7%	PCR(금액기준)	1.47	VKOSPI	17.07%(-0.07%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	372.5(K+3)	0.88	-0.56	75,105	15,220	5	13.3	Put
	370.0(K+2)	1.46	-0.74	80,916	21,543	2,133	13.6	
	367.5(K+1)	2.25	-0.88	48,210	10,630	921	13.9	
	365.0(K+0)	3.27	-1.13	27,189	11,502	630	14.1	
	362.5(K-1)	4.58	-1.28	11,818	9,313	-694	14.5	

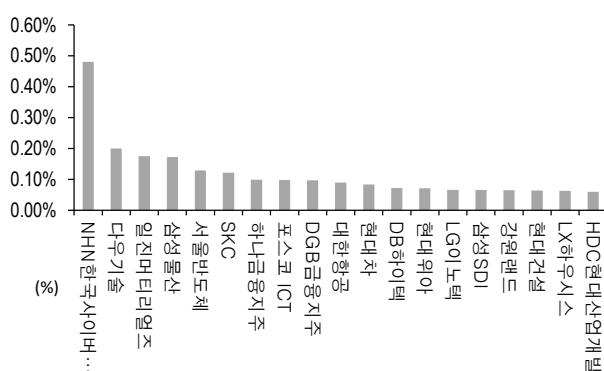
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,332,805	1,672.6	4,667,804	-11,294	-6,283	23,974	-18,418	-17.3	39.6	-22.5
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
LG 유플러스	13,950	-0.71	5.2	58.1	53,838	-8,614	-0.09%	4,872	-9,248	4,376
일진미티리얼즈	95,800	-1.14	16.7	57.2	108,859	1,212	0.17%	-813	8,004	-7,201
SK 하이닉스	116,000	-1.69	239.7	53.9	187,076	2,861	-0.17%	-613	18,061	-17,308
한국금융지주	77,400	-1.15	4.6	47.8	22,421	-950	0.01%	-729	32	697
LG 이노텍	385,500	-0.39	36.6	44.8	14,814	678	0.07%	-250	349	-99
현대차	177,500	-1.39	35.7	43.2	46,304	1,458	0.08%	-274	2,487	-2,221
LG 화학	524,000	-2.06	41.5	40.0	10,693	-463	0.02%	-646	249	397
하나금융지주	48,500	-0.41	14.4	39.0	92,605	2,453	0.10%	1,860	2,062	-3,922
현대건설	47,500	-0.84	8.6	38.2	25,065	-186	0.06%	2,442	848	-3,290
현대제철	40,700	-1.93	5.8	37.8	18,586	543	0.05%	-3,287	671	2,616

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터