

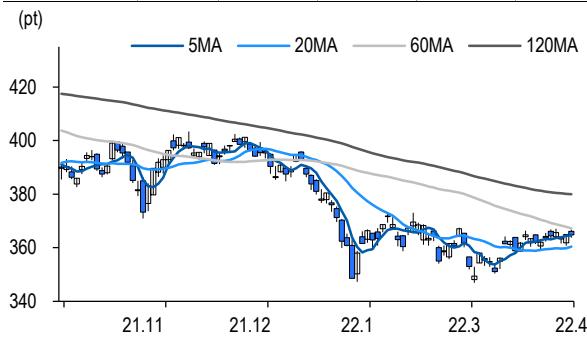


선물옵션시장 지표

2022.4.6

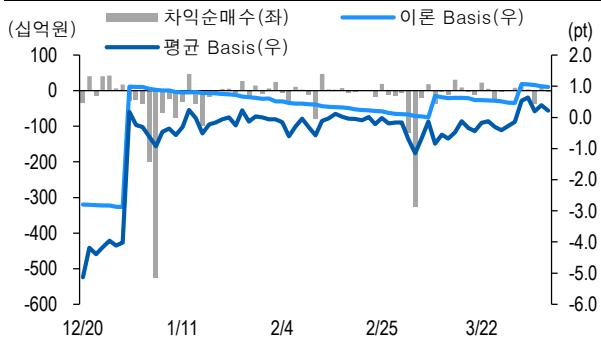
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	364.74	-0.05	-0.20	5,214.7	-
선물 6월물	365.30	-0.05	-0.20	14,372.3	254,414
선물 9월물	365.05	-0.07	-0.25	12.2	9,132
4월물(mini)	364.90	-0.08	-0.28	1,153.1	73,853
5월물(mini)	364.94	-0.07	-0.26	11.2	2,423



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.98	0.22	0.56	-0.21%
베이시스(mini)	0.14	-0.06	0.16	-0.05%
제1스프레드(SP)	0.36	0.04	0.05	-0.09%
합성선물 베이시스(ATM)	0.14	0.09	0.09	-0.01%



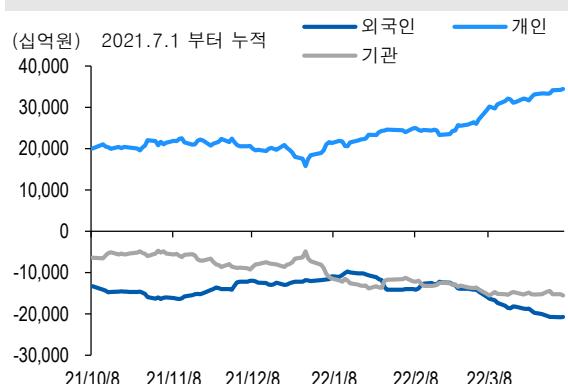
투자주체별 매매 동향

(십억원)

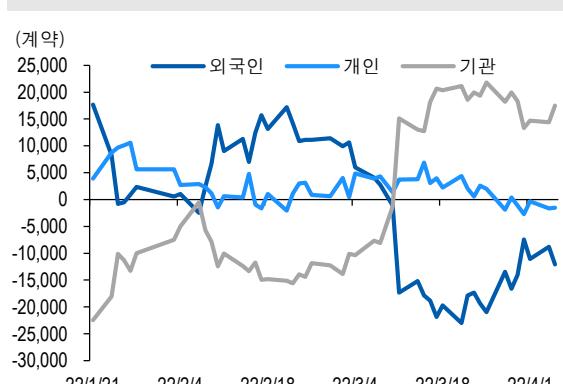
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	13.9	30.4	44.3	-2.8	2.3	-353.9	51.7	0.7	0.7	-9.0
개인	238.6	16.3	254.9	0.0	-2.3	-3.1	9.5	0.8	-1.5	12.5
기관	-247.7	-48.6	-296.2	-1.5	-39.0	340.2	-58.7	-1.5	1.0	-0.6
금융투자	-191.7	-49.8	-241.5	-1.5	3.6	370.5	-59.6	-0.2	0.9	-19.6
투신	-22.7	1.9	-20.9	0.0	-10.8	-61.4	0.9	0.0	0.0	33.0
은행+보험+기타금융	-21.3	-12.1	-33.4	0.0	-11.8	31.3	0.0	-1.2	0.2	0.0
연기금+국가지자체	-12.3	3.0	-9.2	0.0	-19.9	-0.2	0.0	0.0	0.0	-13.9
기타법인	-4.8	1.9	-2.9	0.0	-0.5	16.7	-2.5	-0.1	-0.3	-2.9

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	569,572	136.1	857,989	12.8%	지수옵션 전체	1,325,546	300.1	2,296,812							
Put	755,974	164.0	1,438,823	14.4%	PCR(금액기준)	1.20	VKOSPI	15.91%(-0.58%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	372.5(K+3)	0.67	-0.26	80,731	17,335	362	12.7	Put	367.5(K+1)	4.60	-0.25	4,436	3,317	425	12.9
	370.0(K+2)	1.20	-0.35	87,968	22,824	-310	12.8		365.0(K+0)	3.29	-0.20	21,998	8,909	-226	13.4
	367.5(K+1)	2.02	-0.44	60,272	12,620	625	13.0		362.5(K-1)	2.30	-0.23	52,919	12,516	450	14.0
	365.0(K+0)	3.12	-0.49	35,440	13,910	843	13.2		360.0(K-2)	1.50	-0.25	80,407	19,341	681	14.2
	362.5(K-1)	4.67	-0.53	7,660	9,108	-223	13.9		357.5(K-3)	0.99	-0.24	83,273	13,454	-241	14.7

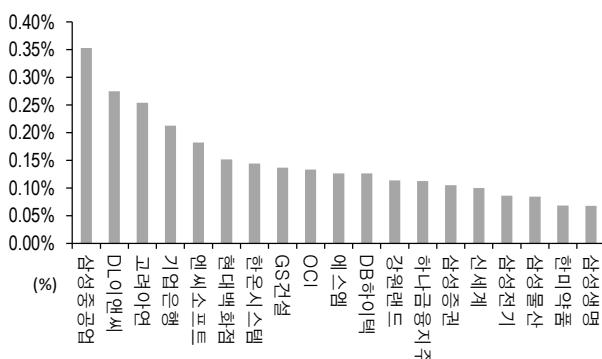
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	2,322,884	1,745.3	4,779,287	100,780	-16,563	46,154	-24,225	-9.0	12.5	-0.6	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
현대차	179,000	0.56	52.0	73.2	46,359	2,022	0.06%	78	-37	-41	-370
삼성전자	69,300	-0.14	362.9	62.0	985,108	-70,136	0.01%	9,566	2,809	-12,475	-16,810
엔씨소프트	481,000	0.73	33.2	61.1	10,921	135	0.18%	191	29	-255	-560
삼성전기	162,500	0.31	33.9	60.4	26,249	-2,732	0.09%	149	372	-501	-2,487
고려아연	606,000	0.66	13.9	59.1	1,968	987	0.25%	138	-64	-73	-807
SK 하이닉스	116,500	-0.85	143.6	58.8	191,245	-1,350	-0.19%	3,172	-5,271	2,003	2,615
일진마티리얼즈	101,000	1.81	23.6	54.1	90,672	-8,214	0.06%	243	2,550	-2,719	-5,873
현대건설	46,250	0.76	9.3	53.6	30,052	2,617	-0.12%	874	1,418	-2,332	-868
한국금융지주	77,500	-1.02	4.7	52.9	21,709	-536	-0.02%	-628	-2	670	822
한화시스템	16,050	-1.83	5.1	49.3	30,669	17,092	-0.80%	-458	6,718	-6,260	10,699

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터