

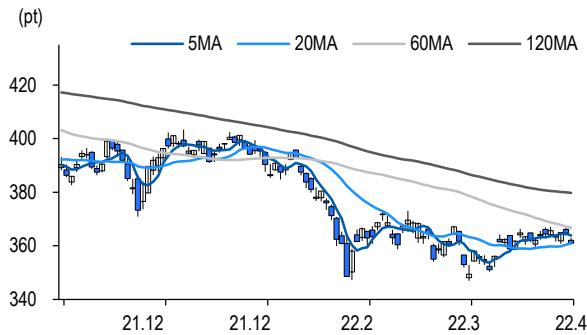


선물옵션시장 지표

2022.4.7

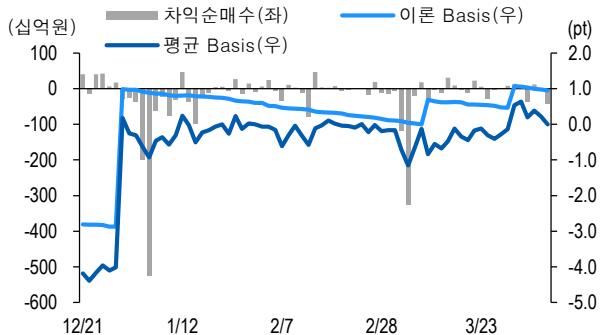
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	361.01	-1.02	-3.73	6,434.2	-
선물 6월물	361.35	-1.08	-3.95	17,378.5	253,366
선물 9월물	361.20	-1.05	-3.85	15.5	9,151
4월물(mini)	361.18	-1.02	-3.72	1,326.0	71,939
5월물(mini)	361.02	-1.07	-3.92	31.4	2,886



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.96	0.00	0.34	-0.26%
베이시스(mini)	0.12	-0.16	0.17	-0.08%
제1스프레드(SP)	0.36	0.03	0.00	-0.09%
합성선물 베이시스(ATM)	0.12	0.15	0.15	0.01%



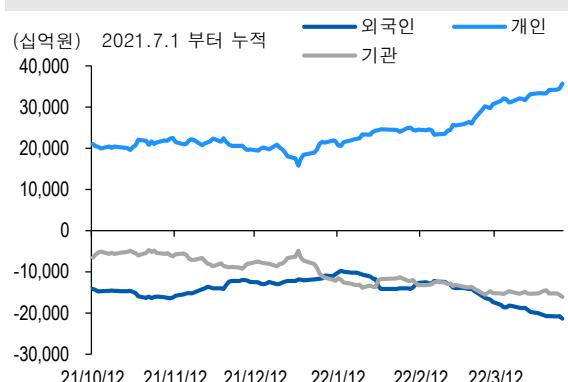
투자주체별 매매 동향

(십억원)

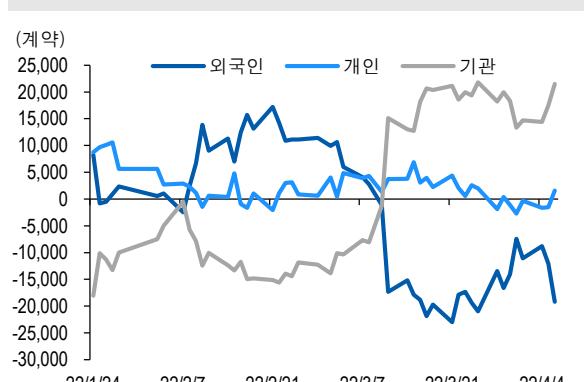
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-583.2	-23.2	-606.4	-5.4	-259.0	-648.5	10.5	0.7	1.0	-1.6
개인	1,138.9	55.9	1,194.8	0.0	9.3	236.6	48.6	0.1	-0.3	-8.2
기관	-564.8	-37.1	-602.0	-35.8	-9.8	419.8	-57.1	-0.4	-0.7	9.8
금융투자	-441.6	-85.0	-526.6	-8.5	-1.6	565.7	-54.1	-0.2	-0.7	52.0
투신	-8.4	3.7	-4.7	0.0	4.8	-183.7	-0.1	-0.2	0.0	-67.9
은행+보험+기타금융	-23.7	30.6	7.0	0.0	-5.2	-1.1	-2.9	0.0	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-96.2	4.7	-91.5	-27.3	-8.3	38.8	0.0	0.0	0.0	25.8
기타법인	9.2	4.5	13.7	0.0	-0.1	-7.8	-1.9	-0.4	0.0	-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								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	667,925	143.3	884,530	13.4%	지수옵션 전체	1,397,488	342.2	2,344,755							
Put	729,563	198.9	1,460,225	14.9%	PCR(금액기준)	1.39	VKOSPI	16.79%(+0.88%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	372.5(K+3)	0.21	-0.46	87,408	22,260	4,925	13.0	Put	367.5(K+1)	7.18	2.58	2,080	3,049	-268	13.1
	370.0(K+2)	0.45	-0.75	123,725	22,710	-114	13.2		365.0(K+0)	5.39	2.10	7,319	8,776	-133	13.6
	367.5(K+1)	0.87	-1.15	100,760	18,196	5,576	13.4		362.5(K-1)	3.88	1.58	25,331	12,359	-157	13.9
	365.0(K+0)	1.55	-1.57	89,204	17,676	3,766	13.7		360.0(K-2)	2.73	1.23	69,938	19,934	593	14.5
	362.5(K-1)	2.60	-2.07	45,646	11,144	2,036	14.3		357.5(K-3)	1.88	0.89	69,061	13,120	-334	15.1

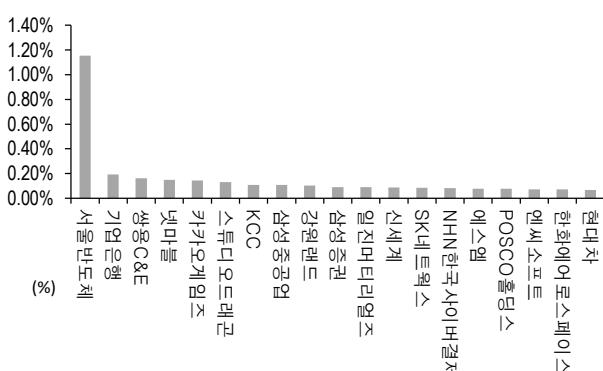
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VКОSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 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	2,708,857	2,076.2	4,822,272	42,985	-10,302	-25,274	34,784	-1.6	-8.2	9.8		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리를 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
현대차	180,500	0.84	75.0	65.2	52,924	6,565	0.07%	-460	4,546	-4,096	-1,522	-4,345
엔씨소프트	475,500	-1.14	28.9	63.1	10,614	-307	0.07%	-110	-242	370	-66	544
GS건설	43,850	-1.79	18.9	56.1	50,810	-6,831	0.05%	2,394	-8,466	6,147	1,429	4,290
삼성 SDI	598,000	-0.33	77.0	54.7	27,144	-180	-0.03%	-385	-987	1,383	688	948
현대건설	45,700	-1.19	11.4	54.5	29,319	-733	-0.11%	2,416	380	-2,756	1,029	775
SK 하이닉스	113,000	-3.00	266.1	52.1	186,734	-4,511	-0.13%	-1,560	12,905	-11,032	767	-200
메리츠증권	6,600	0.30	3.4	50.2	32,516	1,554	-0.32%	-1,271	-1,926	3,550	3,550	0
카카오	104,500	-2.79	79.4	49.7	105,944	-6,558	-0.38%	-6,150	-4,806	10,986	9,346	2,274
LG 이노텍	374,500	-0.93	35.8	49.4	13,639	-505	0.01%	759	339	-1,110	-186	-303
현대제철	40,900	-0.73	5.0	45.3	20,939	-266	0.02%	-2,454	77	2,382	1,047	931

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터