

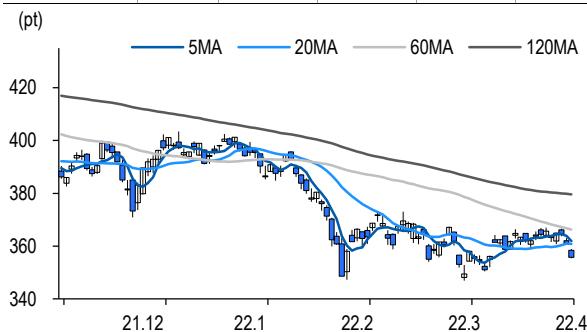


선물옵션시장 지표

2022.4.8

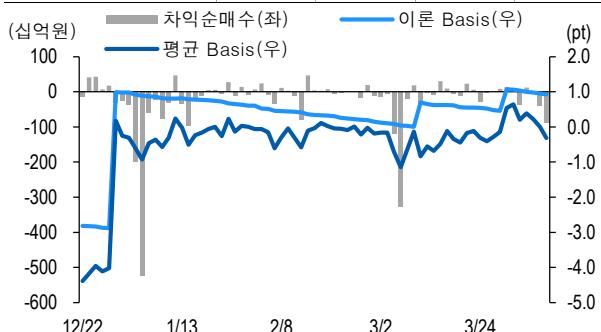
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	355.73	-1.46	-5.28	7,623.9	-
선물 6월물	356.20	-1.43	-5.15	22,312.1	257,999
선물 9월물	356.15	-1.40	-5.05	52.0	9,217
4월물(mini)	356.12	-1.40	-5.06	1,570.6	67,262
5월물(mini)	356.20	-1.34	-4.82	16.7	3,326



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.93	-0.32	0.47	-0.35%
베이시스(mini)	0.10	-0.35	0.39	-0.13%
제1스프레드(SP)	0.34	0.00	0.00	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	0.42	0.42	0.09%



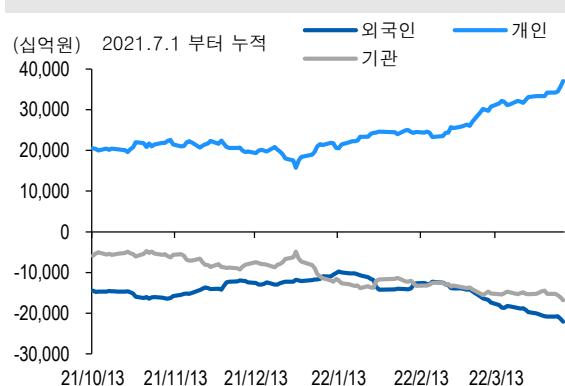
투자주체별 매매 동향

(십억원)

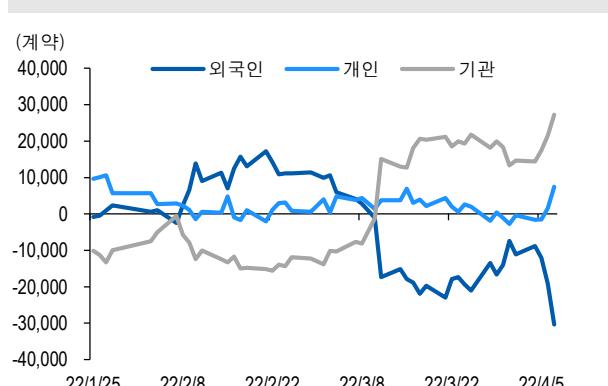
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-770.4	62.0	-708.4	-17.2	-521.1	-949.9	-54.9	-0.6	0.0	-7.2
개인	1,282.0	70.1	1,352.1	0.0	1.5	472.7	54.0	-1.0	2.6	17.4
기관	-520.3	-128.7	-649.1	-70.1	-49.0	511.2	-0.7	1.8	-2.9	-8.3
금융투자	-383.0	-166.0	-549.0	-62.9	-87.3	638.4	-1.9	1.8	-3.0	36.0
투신	-59.3	-8.8	-68.1	0.0	-13.9	-135.5	-0.7	-0.2	0.1	-58.9
은행+보험+기타금융	-14.1	22.9	8.8	0.0	-3.1	-11.0	1.8	0.2	0.0	0.0
연기금+국가지자체	-19.0	3.5	-15.4	-7.1	55.9	19.2	0.1	0.0	0.0	14.5
기타법인	8.7	-3.3	5.4	0.0	0.6	-33.9	1.5	-0.3	0.3	-1.8

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	979,950	196.2	961,732	14.8%	지수옵션 전체	2,108,458	497.4	2,454,482							
Put	1,128,508	301.1	1,492,750	15.4%	PCR(금액기준)	1.53	VKOSPI	17.78% (+0.99%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	367.5(K+3)	0.23	-0.64	173,508	24,662	6,466	14.5	Put	362.5(K+1)	7.26	3.38	7,562	12,407	48	12.9
	365.0(K+2)	0.45	-1.10	156,739	30,776	13,100	14.5		360.0(K+0)	5.42	2.69	17,837	18,630	-1,304	13.6
	362.5(K+1)	0.88	-1.72	145,012	19,082	7,938	14.9		357.5(K-1)	3.93	2.05	38,356	11,983	-1,137	14.4
	360.0(K+0)	1.57	-2.38	113,006	18,792	11,044	15.3		355.0(K-2)	2.74	1.50	86,345	18,909	-207	15.0
	357.5(K-1)	2.56	-3.02	46,801	10,343	6,360	15.8		352.5(K-3)	1.85	1.01	96,689	14,353	-1,555	15.6

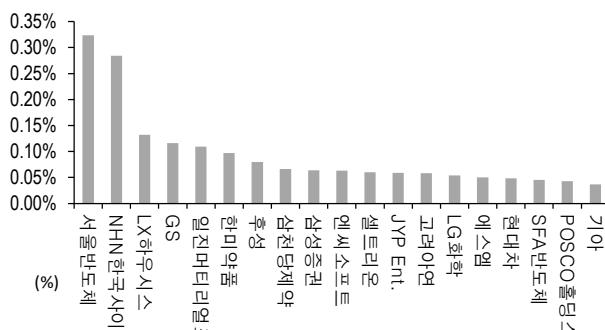
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,722,689	2,916.5	4,808,804	-13,468	-46,873	19,173	29,261	-7.2	17.4	-8.3
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
코스맥스	83,800	-3.12	7.7	79.1	6,287	3,926	-0.65%	187	448	-635
SK 하이닉스	114,000	0.88	420.9	74.7	177,774	-8,960	-0.03%	-4,390	18,852	-14,644
엔씨소프트	461,000	-3.05	31.8	66.3	10,834	220	0.06%	-224	224	0
현대차	179,500	-0.55	92.4	66.1	53,280	356	0.05%	-2,826	425	2,396
삼성 SDI	582,000	-2.68	79.6	54.4	21,179	-5,965	-0.07%	1,114	-4	-1,138
신한지주	40,300	-1.10	24.6	53.7	93,063	14,250	-0.18%	-401	-2,181	2,582
POSCO 훌딩스	281,500	-1.23	32.3	52.5	21,144	-325	0.04%	-377	435	-58
카카오	99,700	-4.59	148.3	51.1	109,451	3,507	-0.20%	4,699	3,277	-7,948
LG 전자	114,000	-0.44	92.8	50.4	47,017	7,318	-0.26%	-3,806	3,881	-162
삼성전자	67,900	-1.02	689.9	49.0	729,313	-174,811	-0.14%	40,882	-18,719	-19,255

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터