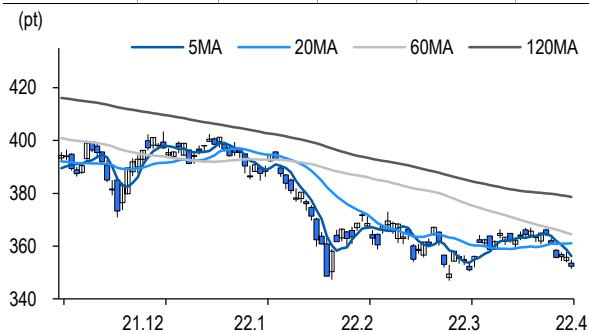


선물옵션시장 지표

2022.4.13

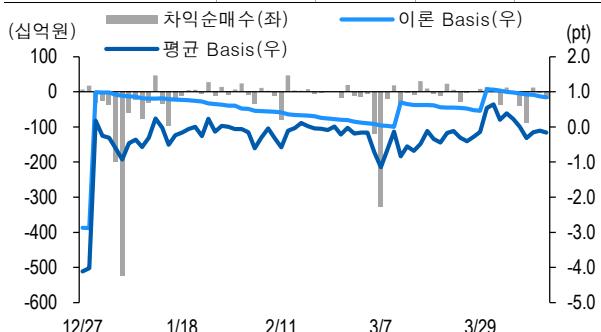
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	352.32	-0.97	-3.46	5,585.7	-
선물 6월물	352.65	-0.95	-3.40	24,088.9	263,228
선물 9월물	352.50	-1.00	-3.55	32.4	9,352
4월물(mini)	352.70	-0.92	-3.28	1,751.8	52,856
5월물(mini)	352.68	-0.93	-3.32	47.6	6,053



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.85	-0.16	0.33	-0.29%
베이시스(mini)	0.03	-0.25	0.38	-0.08%
제1스프레드(SP)	0.32	0.00	0.00	-0.09%
합성선물 베이시스(ATM)	0.03	0.33	0.33	0.09%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-465.9	83.8	-382.1	1.9	-262.7	-345.2	-19.2	0.8	3.4	4.6
개인	562.4	25.6	588.0	0.0	0.3	178.6	16.6	-1.2	-1.4	-7.3
기관	-121.2	-112.9	-234.1	-21.7	-49.1	132.7	1.1	1.1	-1.9	5.6
금융투자	-93.4	-132.0	-225.4	-5.7	-37.6	184.0	1.2	1.5	-2.6	-14.7
투신	-4.9	9.1	4.2	0.0	-4.7	-70.5	-0.2	-0.5	-0.1	9.8
은행+보험+기타금융	6.7	14.8	21.4	0.0	9.6	6.4	0.1	0.2	0.8	-2.0
연기금+국가지자체	-50.3	-2.0	-52.3	-16.0	-11.5	12.8	0.0	0.0	0.0	12.5
기타법인	24.6	3.6	28.2	0.0	1.1	33.8	1.5	-0.8	-0.1	-2.9

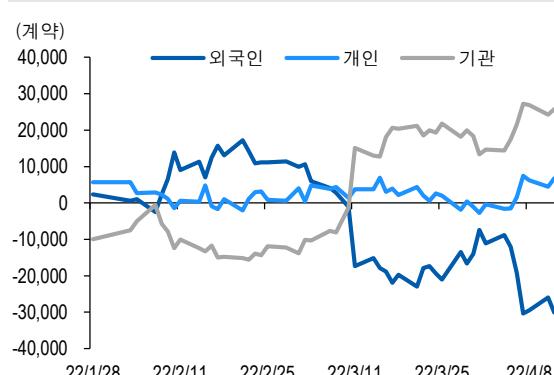
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,593,178	266.7	1,107,660	16.5%	지수옵션 전체	3,324,388	665.2	2,715,587
Put	1,731,210	398.5	1,607,927	16.9%	PCR(금액기준)	1.49	VKOSPI	18.47%(+0.90%p)
(계약, 십억원)								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	362.5(K+3)	0.05	-0.30	207,971	31,001	789	16.0	357.5(K+1)
	360.0(K+2)	0.15	-0.68	317,378	34,619	8,516	15.8	355.0(K+0)
	357.5(K+1)	0.45	-1.24	362,283	26,004	5,073	16.2	352.5(K-1)
	355.0(K+0)	1.11	-1.84	280,400	30,730	11,574	17.0	350.0(K-2)
	352.5(K-1)	2.27	-2.33	122,292	10,964	6,640	18.3	347.5(K-3)
Put								

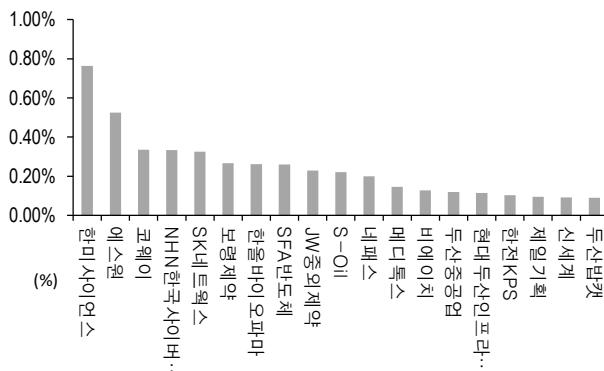
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,239,077	2,485.2	5,050,724	144,770	-1,877	-4,777	12,647	4.6	-7.3	5.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	178,500	-0.56	88.5	81.0	43,756	-1,063	0.01%	896	1,050	-1,946
LG전자	123,000	-1.99	130.3	76.9	34,980	266	-0.03%	37	-580	523
LG이노텍	369,500	0.41	55.2	74.8	10,813	-1,070	0.01%	261	-87	-184
SK하이닉스	112,000	0.45	203.8	67.5	170,138	213	-0.01%	3,148	-6,527	3,379
엔씨소프트	460,000	1.43	29.4	64.4	9,994	-590	0.05%	-498	-129	627
일진마티리얼즈	95,000	-0.73	15.9	64.2	54,318	-11,240	0.01%	1,663	-3,992	2,329
POSCO홀딩스	283,500	-0.87	31.7	57.9	14,683	-3,753	0.06%	773	443	-1,221
삼성전자	67,000	-1.33	511.2	54.8	531,518	-105,392	-0.07%	-13,720	9,412	7,847
삼성전기	155,500	0.32	29.7	54.5	23,905	246	-0.16%	-1,412	1,019	393
와이즈엔터	63,000	2.27	7.7	54.1	11,444	-3,702	0.05%	531	-880	349

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터