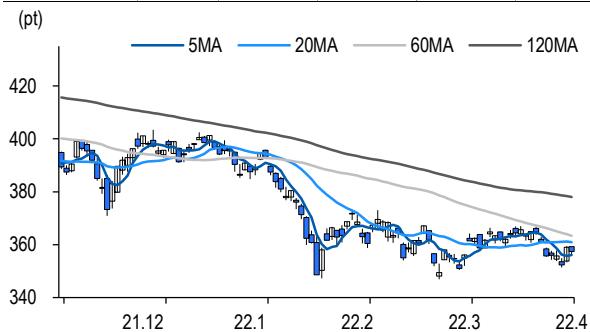


선물옵션시장 지표

2022.4.15

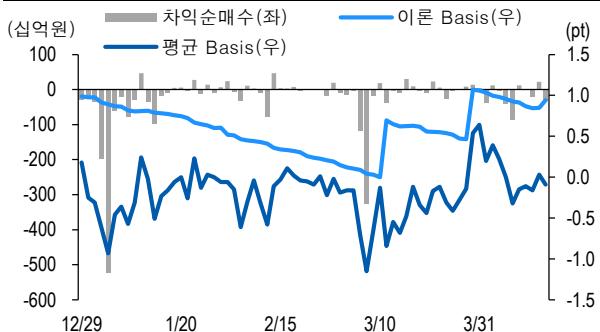
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	357.38	-0.45	-1.62	7,120.5	-
선물 6월물	357.35	-0.40	-1.45	24,132.0	262,383
선물 9월물	357.60	-0.43	-1.55	44.4	9,116
4월물(mini)	357.40	-0.36	-1.28	803.3	0
5월물(mini)	357.20	-0.47	-1.68	729.0	19,522



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.94	-0.09	-0.03	-0.29%
베이시스(mini)	0.00	-0.07	0.02	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.34	0.01	0.05	-0.09%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	0.02	0.02	0.01%

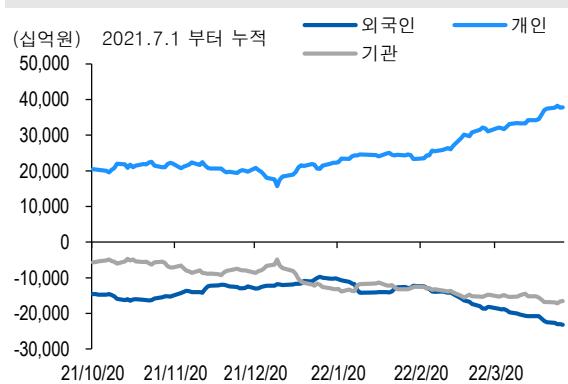


투자주체별 매매 동향 (십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-252.8	110.6	-142.2	1.1	-189.7	-281.7	-22.1	-2.0	0.0	-30.5
개인	86.4	-6.2	80.2	0.0	5.7	64.9	76.3	4.6	-0.9	20.8
기관	158.1	-105.3	52.9	-34.9	136.8	202.2	-52.2	-1.2	2.2	8.2
금융투자	89.8	-101.3	-11.5	-25.8	111.1	485.4	-62.2	1.4	2.2	6.9
투신	77.6	1.3	78.8	0.0	9.0	-300.0	-1.1	-1.1	0.1	36.6
은행+보험+기타금융	14.6	2.2	16.7	0.0	0.8	8.1	11.1	-1.5	-0.1	0.2
연기금+국가지자체	-104.6	-1.4	-106.0	-9.1	7.5	8.6	0.0	0.0	0.0	-35.5
기타법인	8.3	0.9	9.2	0.0	1.0	14.6	-1.9	-1.3	-1.3	1.4

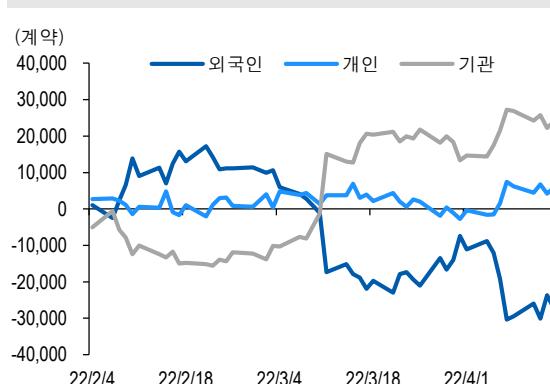
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,950,340	264.8	507,397	8.8%	지수옵션 전체	3,773,785	529.7	1,369,316
Put	1,823,445	264.9	861,919	8.2%	PCR(금액기준)	1.00	VKOSPI	17.13%(+0.11%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	367.5(K+3)	0.01	-0.01	3,499	0	-30,984	21.8	362.5(K+1)
	365.0(K+2)	0.01	-0.06	47,190	0	-38,263	17.1	360.0(K+0)
	362.5(K+1)	0.01	-0.24	248,173	0	-33,670	12.1	357.5(K-1)
	360.0(K+0)	0.05	-0.80	796,938	0	-31,490	9.2	355.0(K-2)
	357.5(K-1)	0.38	-1.76	571,576	0	-29,678	5.8	352.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	362.5(K+1)	5.00	0.96	11,211	0	-12,007	5.8	360.0(K+0)
	360.0(K+0)	2.65	0.55	144,045	0	-21,461	9.0	357.5(K-1)
	357.5(K-1)	0.43	-0.42	524,598	0	-29,549	5.0	355.0(K-2)
	355.0(K-2)	0.04	-0.26	613,715	0	-45,248	8.3	352.5(K-3)
	352.5(K-3)	0.01	-0.09	222,539	0	-34,143	11.8	

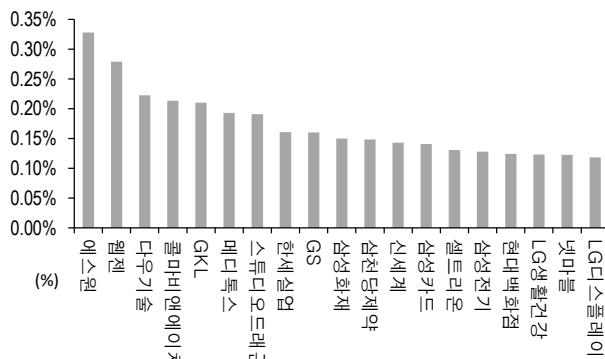
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,698,766	3,646.6	3,846,832	-1,263,392	-34,381	67,618	-32,652	-30.5	20.8	8.2	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
한화시스템	16,300	2.19	9.2	108.7	0	-37,213	0.10%	430	-7,183	6,754	-1,924
셀트리온헬스케어	61,400	-0.32	24.0	72.9	0	-25,155	0.09%	2,014	-319	-1,694	-2,696
아모레퍼시픽	163,500	1.24	25.3	57.9	0	-13,293	0.04%	-789	-165	953	927
삼성전자	67,600	-1.31	597.0	53.7	0	-360,628	-0.04%	-21,187	-11,573	32,879	37,837
씨젠	44,900	-0.66	10.8	53.3	0	-25,417	0.08%	504	-354	-150	1,375
셀트리온	163,000	-0.91	29.3	50.0	0	-21,653	0.13%	-1,072	1,882	-797	-831
삼성전기	160,000	0.00	33.2	48.6	0	-16,860	0.13%	-572	1,201	-629	-2,164
현대차	177,000	-1.94	77.1	48.3	0	-42,250	-0.09%	-2,771	2,447	323	-354
LG전자	126,500	-0.39	78.8	40.2	0	-30,700	-0.04%	-1,879	337	1,375	31
GS건설	42,450	-1.85	10.0	36.5	0	-28,452	0.01%	-603	1,551	-947	1

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터