

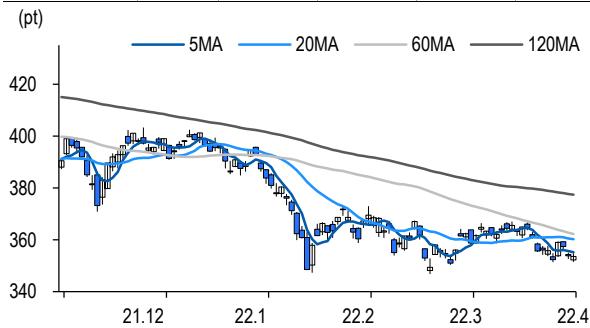


선물옵션시장 지표

2022.4.19

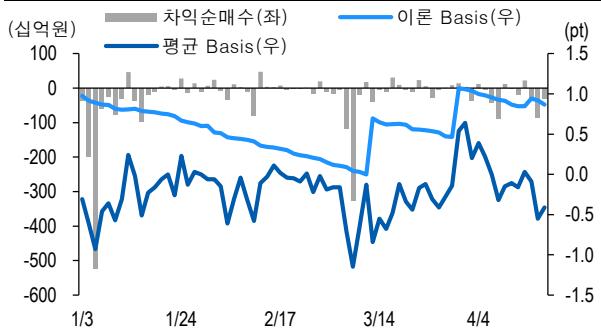
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	353.63	-0.06	-0.21	4,519.3	-
선물 6월물	353.70	0.21	0.75	17,439.2	272,561
선물 9월물	353.70	0.18	0.65	19.2	8,943
5월물(mini)	353.82	0.18	0.62	1,224.4	33,745
6월물(mini)	352.94	-0.01	-0.36	7.7	2,193



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.87	-0.41	0.07	-0.36%
베이시스(mini)	0.40	-0.32	0.19	-0.20%
제1스프레드(SP)	0.51	0.00	0.00	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.40	0.22	0.22	-0.05%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-94.7	81.1	-13.5	-3.4	-33.7	382.7	-21.1	3.7	0.1	7.6
개인	102.0	88.1	190.1	0.0	-1.3	-338.8	-21.1	-2.0	0.2	-12.1
기관	-18.8	-168.4	-187.2	-27.7	10.5	-105.5	44.2	-1.8	-0.5	5.6
금융투자	-52.2	-306.5	-358.7	-38.4	-5.0	-351.6	44.8	1.3	-0.6	-1.5
투신	36.8	122.4	159.2	0.0	8.4	250.8	-0.5	-0.6	0.0	13.1
은행+보험+기타금융	2.3	7.7	9.9	0.0	-1.5	13.3	0.0	-2.5	0.1	0.0
연기금+국가지자체	41.5	-0.5	41.0	10.8	16.3	-18.0	0.0	0.0	0.0	-6.0
기타법인	11.5	-0.9	10.6	0.0	-2.6	61.6	-2.0	0.2	0.2	-1.1

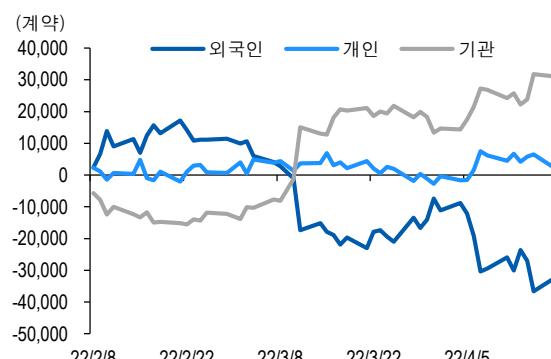
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	508,113	183.8	602,910	15.3%	지수옵션 전체	924,877	354.7	1,567,927
Put	416,764	170.9	965,017	17.9%	PCR(금액기준)	0.93	VKOSPI	18.88%(+1.11%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	362.5(K+3)	2.42	0.10	46,240	7,559	2,170	15.2	357.5(K+1)
	360.0(K+2)	3.30	0.20	39,449	8,592	1,821	15.6	355.0(K+0)
	357.5(K+1)	4.33	0.28	11,380	4,664	1,127	15.9	352.5(K-1)
	355.0(K+0)	5.53	0.25	8,741	5,818	992	16.2	350.0(K-2)
	352.5(K-1)	6.95	0.40	3,297	2,601	972	16.7	347.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	357.5(K+1)	8.02	-0.38	1,540	2,614	211	16.6	JYP Ent.
	355.0(K+0)	6.68	-0.39	4,369	5,891	173	16.8	LG전자
	352.5(K-1)	5.65	-0.25	5,091	3,692	533	17.4	현대위아
	350.0(K-2)	4.68	-0.27	7,702	8,348	697	17.7	JW중외제약
	347.5(K-3)	3.89	-0.18	8,602	3,938	379	18.2	에진제이미컴

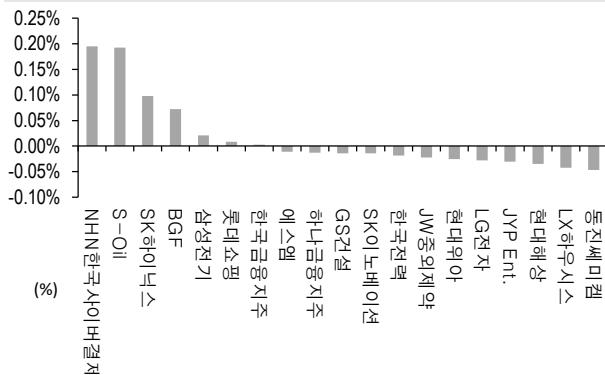
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,716,289	1,916.4	4,310,553	88,397	-38,031	6,416	33,779	7.6	-12.1	5.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
현대차	178,500	0.85	51.9	106.0	47,502	1,861	-0.25%	1,723	1,037	-2,782
SK 하이닉스	109,000	0.46	298.7	103.1	174,364	18,176	0.10%	-691	17,324	-16,353
삼성전기	157,000	0.00	28.6	86.2	26,647	-837	0.02%	-1,117	-629	1,746
삼성전자	66,600	0.00	547.2	81.0	1,151,446	9,680	-0.24%	17,237	-8,966	-8,121
KB금융	59,200	-0.34	16.0	79.6	42,416	3,849	-0.36%	-1,400	168	1,277
삼성 SDI	602,000	-1.95	69.8	69.9	24,782	-2,646	-0.21%	833	-3,282	2,441
LG 화학	499,000	-1.19	27.8	68.4	6,592	-65	-0.33%	-336	35	300
일진마티리얼즈	87,800	-6.70	24.5	65.8	135,790	-9,069	-0.19%	308	-8,187	7,922
LG 이노텍	393,500	-1.38	39.2	64.8	13,048	-89	-0.06%	131	-107	-30
신한지주	40,100	-0.25	8.4	62.2	77,807	182	-0.22%	193	131	-324

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터