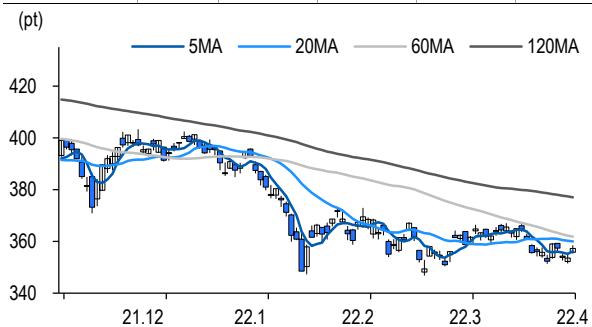


선물옵션시장 지표

2022.4.20

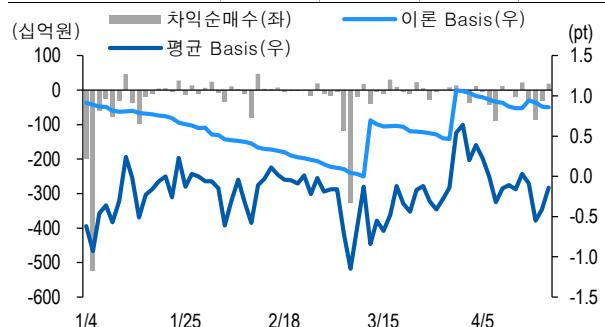
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	357.36	1.05	3.73	5,122.7	-
선물 6월물	357.20	0.99	3.50	19,214.8	267,861
선물 9월물	357.25	1.00	3.55	34.5	9,043
5월물(mini)	357.08	0.92	3.26	1,340.2	36,224
6월물(mini)	357.10	0.96	4.16	6.4	2,117



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.86	-0.14	-0.16	-0.28%
베이시스(mini)	0.39	-0.16	-0.28	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.52	0.00	0.00	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.39	-0.26	-0.26	-0.18%



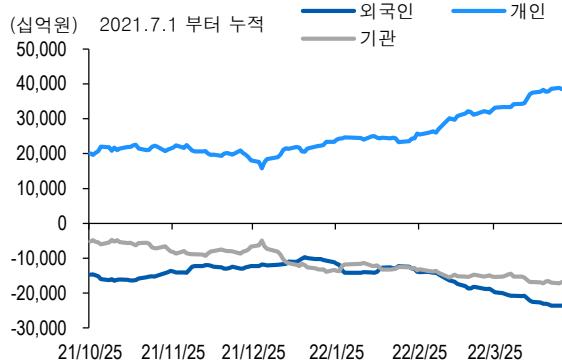
투자주체별 매매 동향

(십억원)

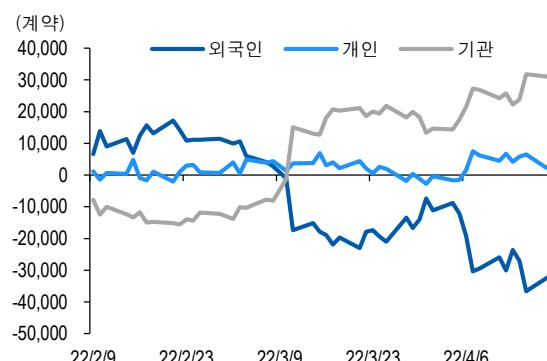
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-0.2	25.5	25.3	5.9	78.2	215.7	-91.7	0.3	2.4	-6.2
개인	-343.5	2.8	-340.6	0.0	0.3	1.7	-31.7	-0.8	-1.9	8.7
기관	361.2	-35.7	325.5	13.0	17.8	-175.3	119.5	0.7	0.0	-3.2
금융투자	176.6	-47.4	129.2	-5.5	1.4	-382.9	119.0	0.8	0.1	32.9
투신	24.2	7.4	31.6	0.0	10.0	228.6	0.0	-0.1	0.0	15.5
은행+보험+기타금융	11.4	-5.3	6.1	0.0	-0.5	-2.8	0.4	0.0	0.0	0.2
연기금+국가지자체	127.6	1.2	128.8	18.1	8.3	-18.2	0.0	0.0	0.0	-51.8
기타법인	-17.5	7.4	-10.2	0.0	-1.6	-42.1	3.9	-0.2	-0.6	0.7

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

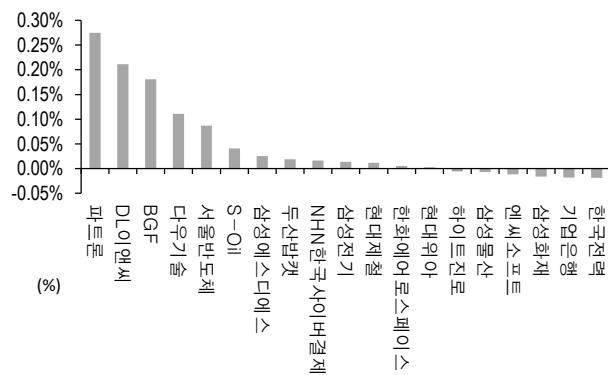
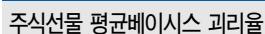
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정						
Call	574,132		197.3	639,833		14.2%	지수옵션 전체		1,073,618		342.3	1,653,774			
Put	499,486		145.0	1,013,941		17.9%	PCR(금액기준)		0.73	VKOSPI		17.69%(-1.19%p)			
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	360.0(K+3)	4.22	0.92	18,319	9,057	465	14.3	Put	355.0(K+1)	4.89	-1.79	8,944	8,006	2,115	17.0
	357.5(K+2)	5.49	1.16	9,520	5,420	756	14.7		352.5(K+0)	4.01	-1.64	8,721	3,798	106	17.3
	355.0(K+1)	6.89	1.36	5,446	5,720	-98	14.8		350.0(K-1)	3.20	-1.48	19,094	9,627	1,279	17.5
	352.5(K+0)	8.61	1.66	1,498	2,605	4	15.4		347.5(K-2)	2.63	-1.26	20,797	4,520	582	18.1
	350.0(K-1)	10.30	1.85	441	1,731	-15	15.5		345.0(K-3)	2.09	-1.08	29,570	13,217	1,478	18.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KBX 유파티클리서치센터



자료: KBX 유판타운 콘텐츠 제공

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	2,931,024	1,950.4	4,449,198	138,645	35,997	32,964	-69,760	-6.2	8.7	-3.2
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
삼성전자	67,300	1.05	770.8	88.3	1,189,362	37,916	-0.18%	-4,123	9,769	-6,246
SK 하이닉스	112,000	2.75	260.7	77.4	179,989	5,625	-0.04%	5,583	-16,544	10,671
일진마티리얼즈	90,400	2.96	11.4	66.2	133,244	-2,546	-0.24%	289	-2,603	2,321
기아	78,300	0.13	39.5	64.3	59,499	208	-0.06%	-1,591	3,004	-1,413
현대차	181,000	1.40	70.9	63.2	51,170	3,668	-0.15%	-772	2,972	-2,200
LG 디스플레이	18,900	3.00	25.5	61.6	213,558	34,660	-0.11%	7,584	41,279	-48,888
호텔신라	83,500	-0.12	9.1	57.3	21,259	2,229	-0.16%	-897	382	515
LG 이노텍	391,000	-0.64	47.4	53.9	13,066	18	-0.03%	-1,126	1,525	-396
한국금융지주	75,200	0.53	4.5	53.8	23,142	30	-0.05%	233	254	-487
LG 전자	124,500	0.00	46.5	52.7	32,778	588	-0.11%	-2,620	2,492	-49

자료: KBX 유파티^{증권} 리서치센터