

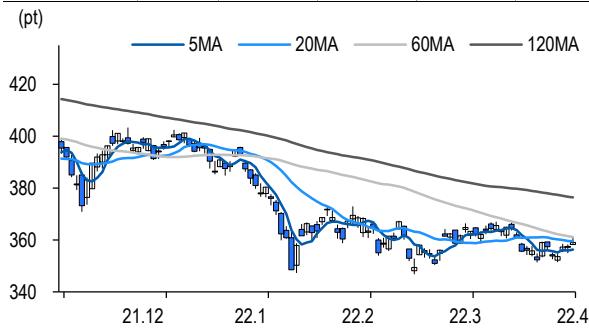


선물옵션시장 지표

2022.4.22

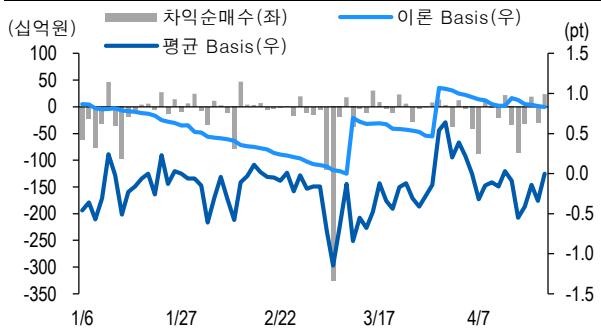
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	359.02	0.42	1.50	6,317.0	-
선물 6월물	358.90	0.55	1.95	19,319.5	267,961
선물 9월물	358.80	0.43	1.55	40.1	9,307
5월물(mini)	358.84	0.50	1.78	1,518.0	43,448
6월물(mini)	358.80	0.52	1.70	9.2	3,121



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.83	0.00	-0.12	-0.23%
베이시스(mini)	0.36	-0.03	-0.18	-0.11%
제1스프레드(SP)	0.53	0.05	0.05	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.36	-0.23	-0.23	-0.16%



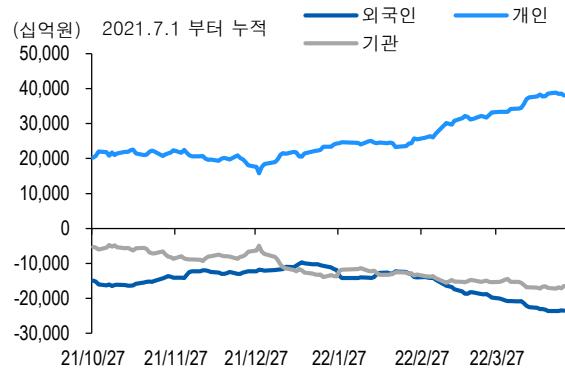
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-59.6	-5.2	-64.9	7.1	-52.8	450.0	-96.3	-1.0	2.5	-17.6
개인	-566.8	35.4	-531.3	0.0	-2.4	-133.8	-0.5	-0.2	0.1	50.3
기관	636.8	-32.9	603.9	16.6	4.0	-374.1	93.5	2.1	-2.2	-32.2
금융투자	510.6	-21.2	489.3	0.2	11.4	-354.5	93.1	3.0	-2.2	-36.0
투신	14.5	2.3	16.8	0.0	-7.0	-7.1	-0.1	0.0	0.0	15.3
은행+보험+기타금융	-14.1	-7.0	-21.1	0.0	-16.0	1.9	0.4	-0.9	0.0	-0.1
연기금+국가지자체	75.9	-5.2	70.7	16.4	14.2	-14.4	0.0	0.0	0.0	-11.4
기타법인	-10.4	2.7	-7.7	0.0	-0.6	57.9	3.3	-0.9	-0.4	-0.5

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

								(계약, 십억원)						
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	574,816	191.3	690,915	13.1%	지수옵션 전체		1,130,726	340.2	1,790,109					
Put	555,910	148.9	1,099,194	16.4%	PCR(금액기준)		0.78	VKOSPI	16.77%(-0.57%p)					
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
	365.0(K+3)	2.35	0.27	59,296	18,265	-503	13.0	360.0(K+1)	5.73	-1.11	7,979	6,688	2,300	15.4
	362.5(K+2)	3.34	0.41	24,775	10,842	7	13.4	357.5(K+0)	4.58	-1.01	9,273	5,725	1,608	15.6
	360.0(K+1)	4.50	0.51	15,402	11,881	1,932	13.6	355.0(K-1)	3.66	-0.91	16,369	9,743	745	16.0
	357.5(K+0)	5.87	0.65	5,872	6,861	597	13.9	352.5(K-2)	2.87	-0.81	23,558	6,153	1,799	16.2
	355.0(K-1)	7.39	0.73	2,375	6,444	106	14.0	350.0(K-3)	2.26	-0.70	36,199	14,865	3,941	16.7

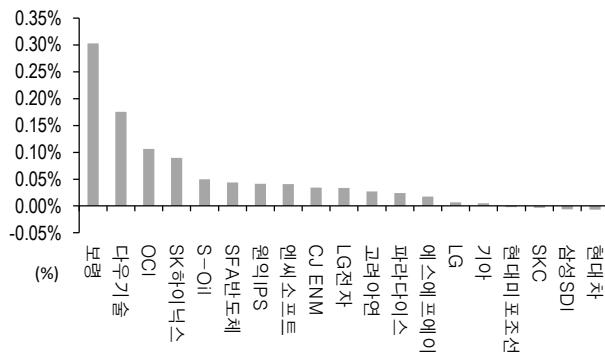
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

											(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
주식선물 전체	2,578,409	1,885.3	4,628,915	109,413	7,723	46,823	-52,294	-17.6	50.3	-32.2				
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	113,000	0.00	289.3	79.7	207,776	31,825	0.09%	-15,613	27,801	-12,188	-20,953	-880		
삼성전자	67,600	0.45	563.9	65.3	1,196,393	19,452	-0.09%	-7,127	30,231	-22,574	-15,577	-12,600		
현대차	183,500	0.00	73.4	61.2	52,610	63	-0.01%	-3,107	437	2,670	666	-98		
삼성 SDI	612,000	0.66	63.1	59.0	26,212	1,248	-0.01%	-726	974	-248	-585	-603		
와이즈엔터	58,300	-1.85	8.5	52.3	13,600	1,596	-0.24%	-105	1,467	-1,362	2,579	0		
호텔신라	83,300	0.12	5.1	51.0	21,935	-616	-0.10%	1,824	-1,664	-160	101	-261		
GS 건설	41,600	0.97	7.2	48.7	41,689	-223	-0.04%	1,937	-2,336	399	-919	1,318		
한국조선해양	95,900	-1.03	10.1	48.3	8,528	-1,025	-0.04%	545	-451	-94	-1,011	917		
메리츠증권	6,690	0.90	3.0	44.7	49,236	-536	-0.37%	-2,523	-917	3,440	3,440	0		
LG 이노텍	387,500	-1.02	30.6	42.6	13,686	325	-0.02%	-181	187	-37	-120	170		

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터