

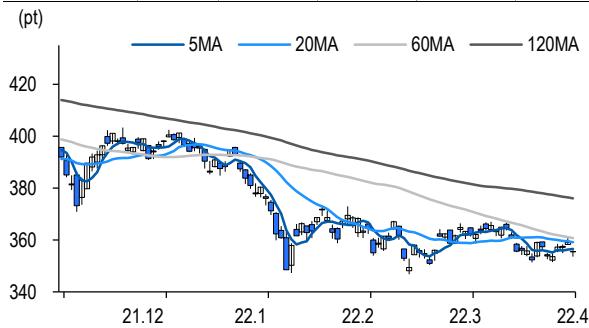


## 선물옵션시장 지표

2022.4.25

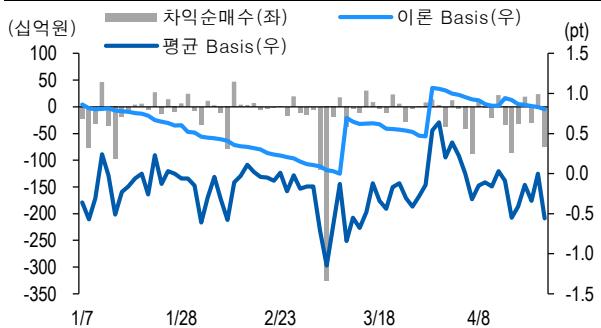
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	355.43	-1.00	-3.59	6,070.3	-
선물 6월물	354.55	-1.21	-4.35	22,321.1	275,831
선물 9월물	354.60	-1.17	-4.20	44.7	9,432
5월물(mini)	354.70	-1.15	-4.14	1,750.3	42,485
6월물(mini)	354.60	-1.20	-4.20	10.5	2,847



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.80	-0.56	-0.88	-0.38%
베이시스(mini)	0.33	-0.42	-0.73	-0.21%
제1스프레드(SP)	0.52	0.05	0.05	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.33	-0.66	-0.66	-0.28%



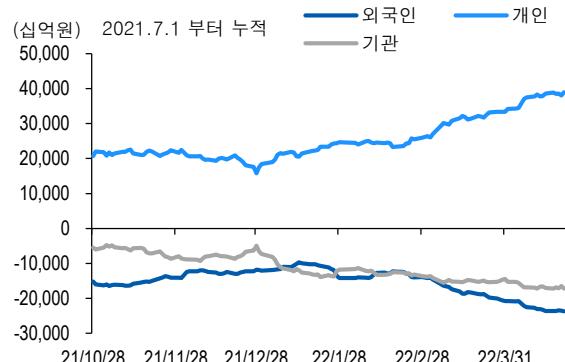
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-155.7	-31.6	-187.3	-2.1	-53.9	-1,081.6	-5.7	5.0	2.2	-0.1
개인	837.7	40.2	878.0	0.0	3.1	423.0	22.3	-1.0	-4.8	12.0
기관	-698.5	-10.8	-709.3	-72.7	18.3	611.9	-13.5	-3.9	3.0	-11.1
금융투자	-598.2	-47.2	-645.4	-38.7	-2.9	921.5	-12.1	-3.0	4.1	7.6
투신	0.2	6.9	7.1	0.0	22.0	-389.3	-0.5	0.0	0.0	-51.9
은행+보험+기타금융	-15.6	14.1	-1.6	0.0	-2.3	45.6	-1.0	-1.0	-1.1	9.0
연기금+국가지자체	-63.3	2.4	-60.9	-34.0	7.9	34.1	0.0	0.0	0.0	24.2
기타법인	16.4	2.2	18.6	0.0	-0.1	46.7	-3.0	-0.1	-0.4	-0.9

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	574,591	159.7	701,575	12.8%	지수옵션 전체		1,145,454	375.1	1,825,839		
Put	570,863	215.5	1,124,264	17.1%	PCR(금액기준)		1.35	VKOSPI	17.75% (+0.98%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	367.5(K+3)	0.78	-0.85	63,427	15,248	914	12.5	362.5(K+1)	9.59	2.54	879
	365.0(K+2)	1.27	-1.08	88,211	19,441	1,176	12.9	360.0(K+0)	8.03	2.30	4,143
	362.5(K+1)	1.85	-1.49	46,217	11,087	245	12.9	357.5(K-1)	6.63	2.05	4,953
	360.0(K+0)	2.80	-1.70	44,983	13,344	1,463	13.5	355.0(K-2)	5.37	1.71	10,061
	357.5(K-1)	3.80	-2.07	15,362	8,030	1,169	13.5	352.5(K-3)	4.31	1.44	11,496
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	362.5(K+1)	9.59	2.54	879	1,695	111	16.3	360.0(K+0)	8.03	2.30	4,143
	360.0(K+0)	8.03	2.30	4,143	6,341	-347	16.6	357.5(K-1)	6.63	2.05	4,953
	357.5(K-1)	6.63	2.05	4,953	5,468	-257	16.8	355.0(K-2)	5.37	1.71	10,061
	355.0(K-2)	5.37	1.71	10,061	10,807	1,064	16.9	352.5(K-3)	4.31	1.44	11,496
	352.5(K-3)	4.31	1.44	11,496	6,973	820	17.1				

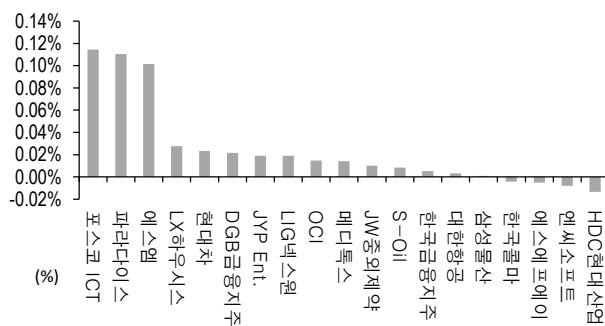
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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)	금융투자	개인 순매수	기관 순매수	기관 순매수
주식선물 전체	2,657,771	1,947.6	4,725,001	96,086	-19,982	34,631	-13,613	-0.1	12.0	-11.1				
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인	개인	기관	금융투자	개인 순매수	기관 순매수	연기금등 순매수
현대차	180,000	-1.91	136.4	88.7	54,308	1,698	0.02%	2,210	-743	-1,659	-2,434	60		
SK 하이닉스	110,500	-2.21	222.3	85.2	208,612	836	-0.10%	1,643	3,536	-5,179	4,236	2,934		
KT	36,200	-0.41	19.0	77.0	55,722	10,519	-0.03%	5,480	5,281	-10,761	-8,041	-2,720		
삼성전자	67,100	-0.74	570.4	72.5	1,232,996	36,603	-0.12%	-2,931	8,113	-4,587	-9,021	-5,600		
LG 이노텍	389,000	0.39	54.3	60.2	13,016	-670	-0.02%	433	-568	165	-8	173		
현대모비스	212,500	0.47	35.3	58.4	7,057	494	-0.04%	568	1,012	-1,584	-555	-1,029		
LG 전자	122,500	-2.39	37.8	53.5	36,015	-1,057	-0.03%	-269	-1,108	1,377	115	1,359		
한국조선해양	96,200	0.31	13.8	53.4	8,388	-140	-0.05%	-424	-584	1,026	329	697		
SK	264,500	-0.19	21.4	50.0	9,981	2,127	-0.03%	-1,417	2,355	-928	-536	-388		
SK 이노베이션	218,000	-0.46	26.1	47.4	18,366	-268	-0.03%	-86	-304	350	-817	1,255		

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터