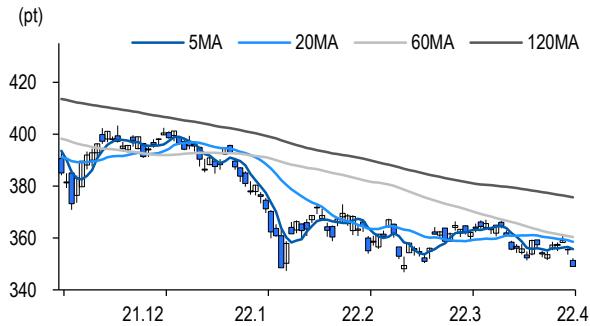


선물옵션시장 지표

2022.4.26

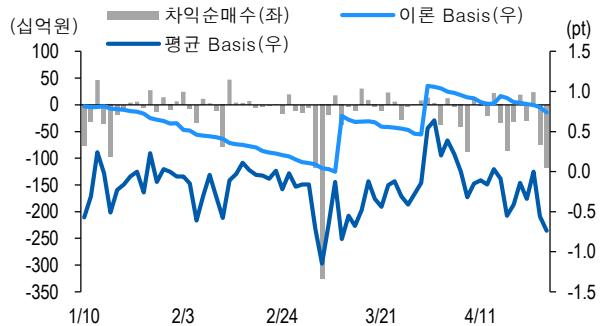
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	348.98	-1.81	-6.45	6,501.2	-
선물 6월물	348.35	-1.75	-6.20	22,043.4	287,770
선물 9월물	348.50	-1.72	-6.10	32.4	10,420
5월물(mini)	348.78	-1.67	-5.92	1,626.7	43,203
6월물(mini)	348.52	-1.70	-6.08	16.5	3,169



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.74	-0.74	-0.63	-0.42%
베이시스(mini)	0.28	-0.52	-0.20	-0.23%
제1스프레드(SP)	0.49	0.05	0.05	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.28	0.04	0.04	-0.07%



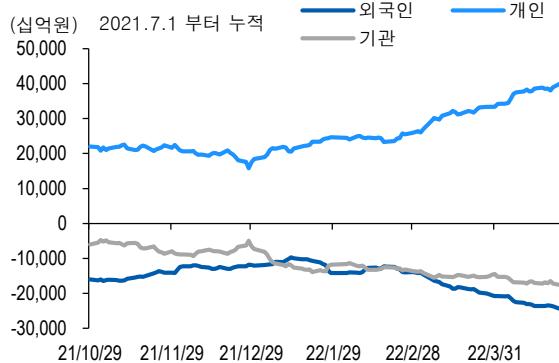
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-733.6	-81.0	-814.6	-64.2	-418.6	-307.7	123.6	2.2	0.8	-23.6
개인	1,064.0	149.7	1,213.8	0.0	-2.3	77.2	31.7	-2.3	3.4	-121.3
기관	-347.6	-69.7	-417.3	-53.8	-16.9	181.2	-153.5	1.2	-4.8	144.6
금융투자	-237.4	-134.0	-371.4	-42.4	-15.8	349.8	-152.8	3.4	-5.2	129.2
투신	-34.1	3.2	-30.8	0.0	-1.3	-155.5	-0.5	0.0	0.2	-27.5
은행+보험+기타금융	-3.5	47.0	43.5	0.0	-0.9	-31.0	-0.2	-2.2	0.1	-2.3
연기금+국가지자체	-7.7	-0.5	-8.2	-11.3	8.4	17.8	0.0	0.0	0.0	45.3
기타법인	17.2	0.9	18.1	0.0	-0.1	49.3	-1.7	-1.1	0.6	0.2

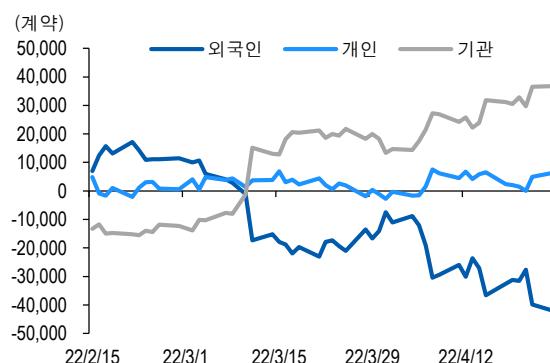
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정						
Call	696,795		198.8	737,378		15.8%	지수옵션 전체		1,487,585	511.7					
Put	790,790		313.0	1,159,092		19.6%	PCR(금액기준)		1.57	VKOSPI					
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	362.5(K+3)	0.88	-0.97	85,219	13,944	2,857	15.5	Put	357.5(K+1)	10.70	4.07	1,061	5,434	-34	18.1
	360.0(K+2)	1.29	-1.51	83,302	16,046	2,702	15.6		355.0(K+0)	8.90	3.53	6,591	10,789	-18	17.9
	357.5(K+1)	2.07	-1.73	61,217	10,962	2,932	16.5		352.5(K-1)	7.60	3.29	5,594	6,198	-775	18.8
	355.0(K+0)	2.92	-2.14	30,518	10,191	1,567	17.0		350.0(K-2)	6.39	2.96	11,575	12,548	-336	19.5
	352.5(K-1)	3.95	-2.56	8,659	5,002	861	17.4		347.5(K-3)	5.33	2.53	14,409	7,465	791	20.0

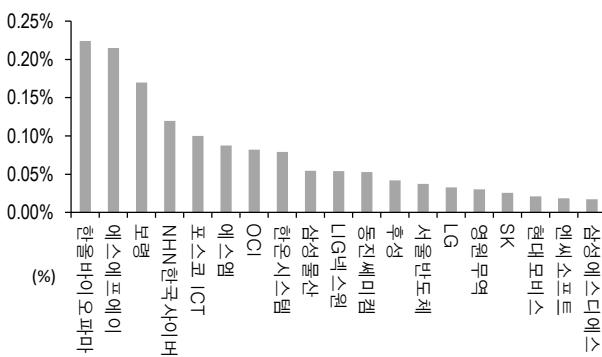
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VКОSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,661,369	2,008.9	4,645,346	-79,655	-38,839	-169,154	209,885	-23.6	-121.3	144.6		
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균과리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수
일진머티리얼즈	82,000	-7.97	40.6	87.3	109,697	-22,063	-0.42%	1,541	-24,487	22,946	22,107	839
SK	259,500	-1.89	27.0	74.8	11,766	1,785	0.03%	-42	2,538	-2,476	-1,380	-1,094
현대차	182,500	1.39	195.0	71.8	52,289	-2,019	-0.16%	-390	-2,638	3,022	-562	2,488
삼성전기	162,500	-2.99	79.5	70.4	31,201	4,005	-0.33%	710	-8,237	7,190	6,181	971
SK 하이닉스	108,000	-2.26	156.3	63.3	185,646	-22,966	-0.40%	-3,517	-22,848	26,560	15,329	11,500
SK 이노베이션	212,500	-2.52	34.0	59.1	15,716	-2,650	-0.11%	665	-1,291	630	1,247	1,489
한국조선해양	95,000	-1.25	10.0	58.5	8,721	333	-0.06%	-1,114	485	634	767	-138
LG 이노텍	372,500	-4.24	63.9	56.9	12,881	-135	-0.01%	562	-974	412	172	240
LG 화학	486,500	-0.10	62.2	55.9	7,732	162	-0.11%	530	23	-550	-897	-1,046
기아	79,800	0.25	82.7	54.3	78,991	113	-0.07%	-6,592	5,342	1,231	-2,764	1,413

자료: KBY 유파티즌과 리서치센터