

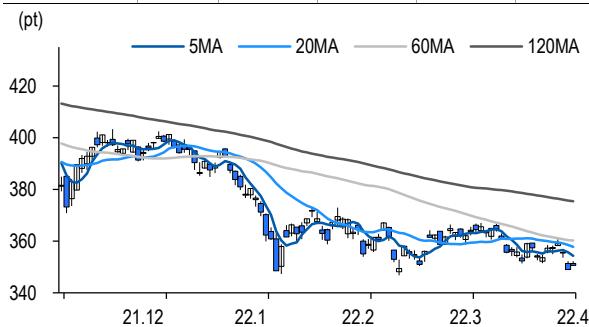


## 선물옵션시장 지표

2022.4.27

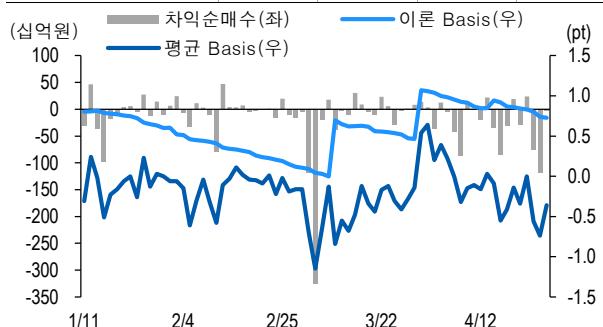
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	350.67	0.48	1.69	6,414.0	-
선물 6월물	350.05	0.49	1.70	17,198.4	280,041
선물 9월물	350.10	0.46	1.60	36.0	10,463
5월물(mini)	350.30	0.44	1.52	1,357.5	41,610
6월물(mini)	350.18	0.52	1.66	12.6	3,159



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.73	-0.36	-0.62	-0.31%
베이시스(mini)	0.26	-0.27	-0.37	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.50	0.04	0.00	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.26	-0.40	-0.40	-0.19%



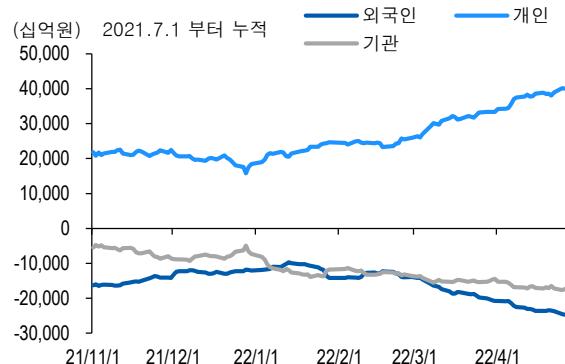
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

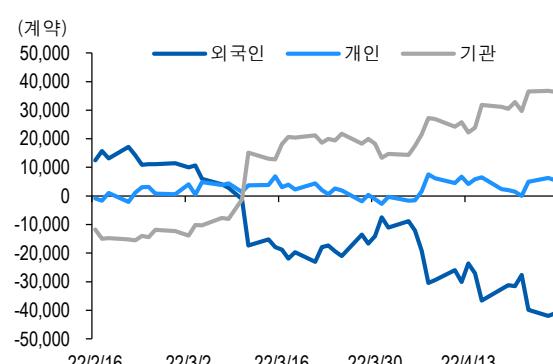
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-252.5	19.1	-233.4	9.4	-107.6	158.6	-79.6	0.6	0.4	7.7
개인	-61.0	-11.7	-72.7	0.0	-0.7	-57.7	-2.2	-3.0	1.2	-20.8
기관	275.9	-8.0	267.9	-12.6	16.4	-110.4	74.2	2.7	-2.3	12.2
금융투자	146.6	-42.3	104.2	-12.6	1.1	-339.8	72.0	3.0	-1.8	67.5
투신	31.2	-18.4	12.8	0.0	17.4	263.6	1.1	-0.2	-0.4	-13.4
은행+보험+기타금융	-29.1	21.9	-7.1	0.0	-19.9	-33.3	1.1	-0.1	0.0	0.0
연기금+국가지자체	135.4	37.2	172.6	0.0	20.1	-0.9	0.0	0.0	0.0	-42.0
기타법인	37.7	0.6	38.3	0.0	-0.1	9.4	7.5	-0.3	0.7	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

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	562,685	173.8	761,057	15.4%	지수옵션 전체	1,119,441	359.2	1,948,977						
Put	556,756	185.4	1,187,920	20.1%	PCR(금액기준)	1.07	VKOSPI	19.94%(-1.11%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성							
Call	357.5(K+3)	2.13	0.06	60,085	13,653	2,691	15.4	352.5(K+1)	6.37	-1.23	4,247	6,327	129	18.4
	355.0(K+2)	3.05	0.13	29,634	11,508	1,317	15.8	350.0(K+0)	5.22	-1.17	9,679	12,006	-542	18.8
Put	352.5(K+1)	4.16	0.21	10,544	5,061	59	16.2	347.5(K-1)	4.26	-1.07	11,700	6,815	-650	19.4
	350.0(K+0)	5.49	0.29	8,549	5,258	391	16.6	345.0(K-2)	3.41	-0.93	23,922	14,695	14	19.8
	347.5(K-1)	6.98	0.42	1,962	1,477	112	16.9	342.5(K-3)	2.79	-0.81	30,572	9,429	394	20.5

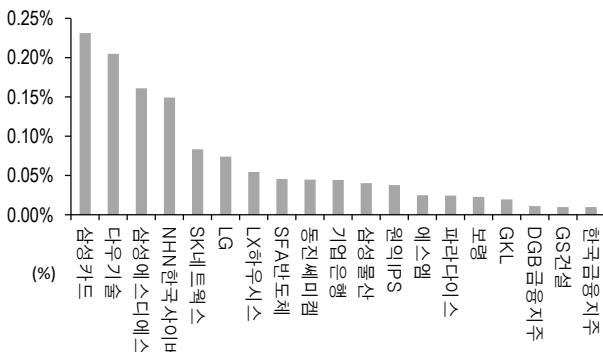
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	2,458,911	2,010.0	4,690,358	45,012	16,004	-36,583	19,729	7.7	-20.8	12.2	
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수
일진마티리얼즈	84,900	3.54	20.2	94.3	105,247	-4,450	-0.40%	2,707	-7,661	4,954	5,010
SK 하이닉스	110,500	2.31	248.9	76.6	191,063	5,417	-0.37%	7,017	-7,355	287	12,401
LG 이노텍	370,000	-0.67	53.8	67.8	12,447	-434	-0.01%	-347	653	-326	-85
현대제철	42,250	-0.24	17.7	60.6	18,378	2,498	-0.05%	-1,770	2,628	-858	-586
한국조선해양	93,000	-2.11	11.1	56.3	7,736	-985	-0.09%	461	512	-973	702
현대차	187,500	2.74	241.5	55.3	57,603	5,314	-0.03%	-4,543	1,594	2,958	396
삼성 SDI	580,000	0.69	45.0	53.4	23,796	313	-0.08%	-130	-225	357	455
SK	261,500	0.77	18.6	50.5	12,777	1,011	0.00%	-258	971	-763	-614
하나금융지주	47,200	-1.05	25.3	49.7	95,439	-875	-0.01%	-434	1,726	-1,422	904
삼성전자	66,200	-0.15	405.5	47.7	1,204,239	24,305	-0.16%	-4,194	6,012	-1,999	21,886

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터