

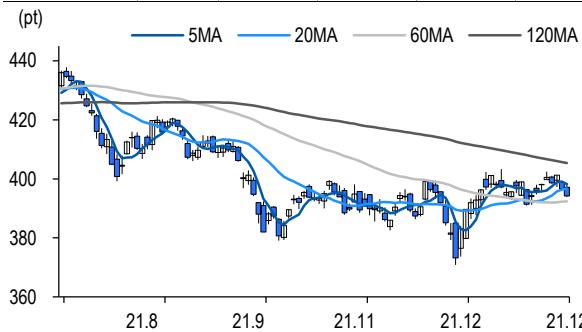


선물옵션시장 지표

2022.1.3

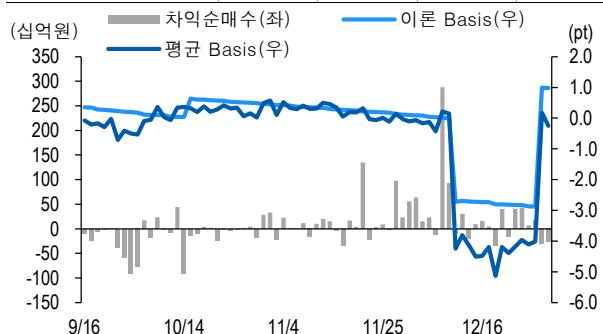
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	394.19	-0.64	-2.53	6,338.0	-
선물 3월물	394.25	-0.52	-2.05	21,949.6	243,343
선물 6월물	394.40	-0.54	-2.15	13.1	10,199
1월물(mini)	393.72	-0.50	-1.98	2,401.9	69,680
2월물(mini)	393.80	-0.61	-2.42	2.2	3,587



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.98	-0.25	0.06	-0.31%
베이시스(mini)	0.20	-0.73	-0.47	-0.23%
제1스프레드(SP)	0.64	0.23	0.20	-0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	0.20	-0.44	-0.44	-0.16%



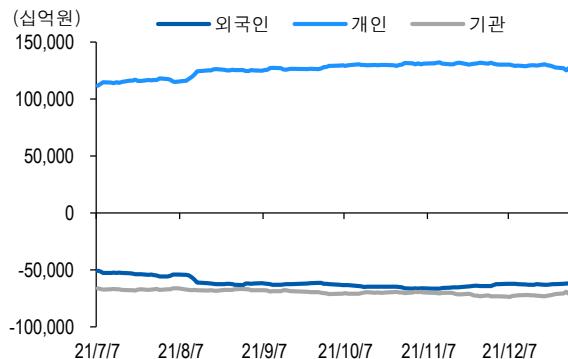
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-224.8	33.7	-191.1	-1.1	-239.0	-762.9	199.1	0.4	-5.6	-23.9
개인	953.8	-64.9	888.9	0.0	2.9	85.1	9.5	1.4	0.7	13.0
기관	-749.5	31.0	-718.5	-25.5	76.6	635.8	-203.5	-1.3	4.7	9.6
금융투자	-917.7	16.9	-900.8	-9.5	-3.8	875.1	-203.5	-1.2	4.6	-45.6
투신	111.2	25.1	136.2	0.0	56.1	-286.9	0.0	-0.1	0.1	58.7
은행+보험+기타금융	8.0	-31.4	-23.3	0.0	-6.5	1.8	0.0	0.0	0.0	-0.6
연기금+국가지자체	-46.9	0.2	-46.6	-16.0	-17.9	45.8	0.0	0.0	0.0	-2.9
기타법인	20.5	0.2	20.7	0.0	1.4	42.0	-5.1	-0.5	0.1	1.3

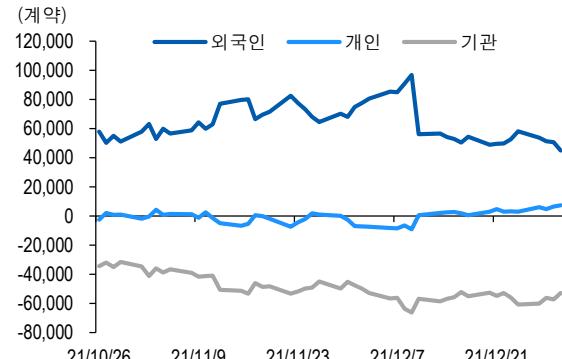
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	632,062	187.1	777,343	13.7%	지수옵션 전체	1,297,895	400.3	2,047,408							
Put	665,833	213.2	1,270,065	15.8%	PCR(금액기준)	1.14	VKOSPI	16.50%(-0.05%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	405.0(K+3)	1.03	-0.52	101,034	29,685	1,918	13.8	Put	400.0(K+1)	8.38	1.10	3,978	5,941	-141	15.9
	402.5(K+2)	1.49	-0.69	63,374	16,709	1,396	13.7		397.5(K+0)	6.70	0.89	8,904	6,685	1,771	15.6
	400.0(K+1)	2.13	-0.87	46,797	23,883	1,343	13.6		395.0(K-1)	5.27	0.71	11,166	8,346	348	15.6
	397.5(K+0)	2.95	-1.09	27,047	13,884	3,227	13.5		392.5(K-2)	4.08	0.53	25,501	7,053	27	15.6
	395.0(K-1)	4.03	-1.28	9,815	11,047	-40	13.6		390.0(K-3)	3.12	0.36	49,810	12,813	1,092	15.8

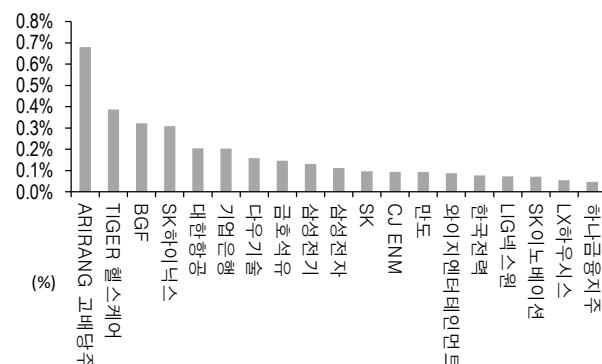
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)
주식선물 전체	3,281,839	3,002.7	6,331,508	137,416	-47,605	19,954	22,120	-23.9	13.0	9.6
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
LG 이노텍	364,500	-0.95	87.7	96.1	23,141	-513	-0.05%	-531	861	-330
삼성전자	78,500	-0.63	960.0	87.5	2,028,579	88,062	0.11%	-4,639	-6,516	10,959
SK 이노베이션	239,000	-0.42	122.9	79.8	40,783	-418	0.07%	-642	-1,548	2,080
SK 하이닉스	131,500	3.14	537.1	79.2	406,236	52,536	0.31%	687	26,174	-26,915
삼성전기	198,000	0.25	70.0	77.3	59,107	4,477	0.13%	18	-226	208
현대차	209,000	-1.65	75.7	62.2	71,038	-2,800	-0.02%	-3,490	-1,362	4,707
LG 전자	139,000	-1.42	58.3	59.9	58,140	-2,355	-0.10%	-827	-1,262	1,949
엔씨소프트	643,000	-2.58	51.5	59.1	15,685	-131	-0.14%	-362	35	327
만도	63,800	1.92	11.4	56.1	23,301	5,114	0.09%	-754	-379	1,133
현대제철	40,900	-0.73	8.1	54.9	24,224	1,548	-0.19%	-465	1,734	-1,269

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터