

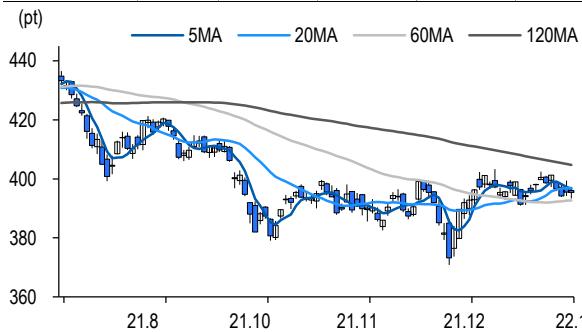


## 선물옵션시장 지표

2022.1.5

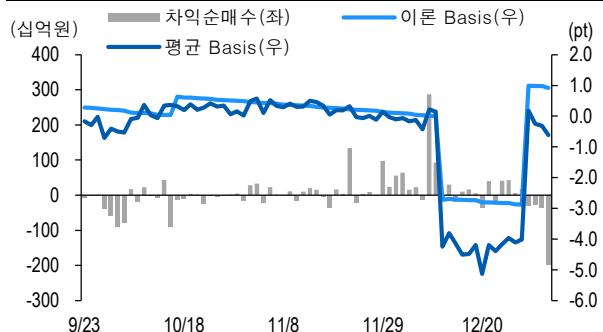
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	395.40	-0.03	-0.11	7,276.7	-
선물 3월물	394.65	-0.16	-0.65	22,422.0	248,274
선물 6월물	394.90	-0.16	-0.65	15.8	10,234
1월물(mini)	394.28	-0.14	-0.54	1,911.0	80,050
2월물(mini)	394.50	-0.20	-0.80	8.0	2,659



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.92	-0.62	-0.75	-0.39%
베이시스(mini)	0.13	-0.98	-1.12	-0.28%
제1스프레드(SP)	0.66	0.25	0.20	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	0.13	-1.08	-1.08	-0.31%



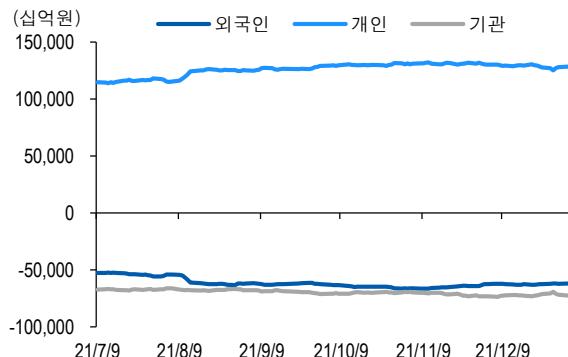
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

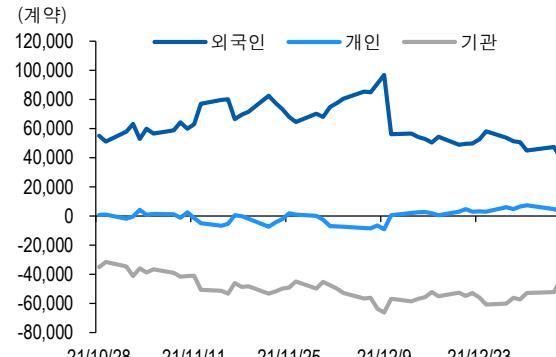
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	90.8	-0.1	90.7	-29.3	-52.4	-705.7	-31.0	0.8	-1.0	14.8
개인	645.4	68.5	713.9	0.0	2.8	-125.8	-14.1	-0.5	0.7	-58.8
기관	-745.8	-70.7	-816.5	-169.6	-41.6	818.4	48.9	0.2	0.3	44.3
금융투자	-764.4	-155.7	-920.1	-146.2	-21.2	521.2	48.0	0.1	-0.1	108.7
투신	44.8	20.8	65.7	-7.9	16.7	269.9	1.2	0.0	0.0	-68.8
은행+보험+기타금융	-3.6	11.9	8.3	0.0	-8.6	-9.9	-0.3	0.1	0.4	-0.7
연기금+국가지자체	-15.8	9.8	-6.0	-15.5	-12.6	37.1	0.0	0.0	0.0	5.1
기타법인	9.6	2.3	11.9	0.0	-3.7	13.2	-3.8	-0.4	-0.1	-0.3

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	781,227	198.4	814,636	12.9%	지수옵션 전체		1,608,147	407.6	2,168,434
Put	826,920	209.2	1,353,798	16.9%	PCR(금액기준)		1.05	VKOSPI	16.00%(-0.57%p)
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	402.5(K+3)	1.04	-0.34	113,710	21,494	2,489	13.1	397.5(K+1)	5.56
	400.0(K+2)	1.61	-0.44	91,237	25,670	1,945	12.9	395.0(K+0)	4.12
	397.5(K+1)	2.39	-0.54	61,749	16,415	1,392	12.5	392.5(K-1)	2.97
	395.0(K+0)	3.44	-0.64	29,410	12,399	1,227	12.1	390.0(K-2)	2.12
	392.5(K-1)	4.81	-0.69	6,255	6,739	-62	11.7	387.5(K-3)	1.48
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가
	397.5(K+1)	5.56	0.01	3,790	7,451	496	17.2	395.0(K+0)	4.12
	395.0(K+0)	4.12	-0.07	12,828	8,862	223	16.8	392.5(K-1)	2.97
	392.5(K-1)	2.97	-0.15	33,533	9,675	1,488	16.6	390.0(K-2)	2.12
	390.0(K-2)	2.12	-0.18	73,305	18,697	1,964	16.7	387.5(K-3)	1.48
	387.5(K-3)	1.48	-0.19	81,687	17,254	1,243	16.9		

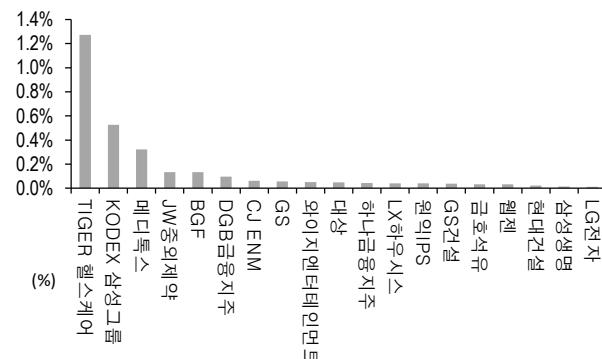
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역사적 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)
주식선물 전체	3,335,574	3,076.3	6,005,151	34,820	27,893	-42,061	12,808	14.8	-58.8	44.3
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK 하이닉스	130,000	0.78	473.2	101.8	358,777	-16,942	-0.17%	4,864	-14,808	9,943
삼성전자	78,600	0.00	918.8	94.1	1,763,844	-30,305	-0.08%	2,833	-7,294	4,600
하나투어	73,500	-1.87	3.8	81.7	7,842	-411	-0.47%	-392	279	113
하나금융지주	42,650	0.35	18.4	65.2	125,993	6,671	0.04%	2,271	6,507	-8,778
현대차	210,500	-0.24	66.6	63.5	67,339	-1,885	-0.03%	179	-1,433	1,279
SK 이노베이션	254,000	2.42	108.1	58.4	39,425	871	-0.08%	1,358	2,411	-3,831
삼성전기	191,500	-1.79	59.4	57.8	55,963	-2,586	-0.04%	568	1,074	-1,549
기아	83,400	0.97	45.9	57.5	80,153	3,228	-0.01%	-48	-6,218	6,261
LG 이노텍	348,500	-6.19	141.4	57.4	22,874	388	-0.01%	108	2,164	-2,296
엔씨소프트	657,000	-1.50	38.3	52.3	15,486	-284	-0.07%	-388	-778	1,187

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터