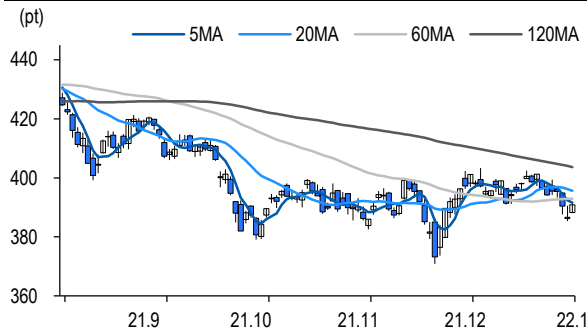


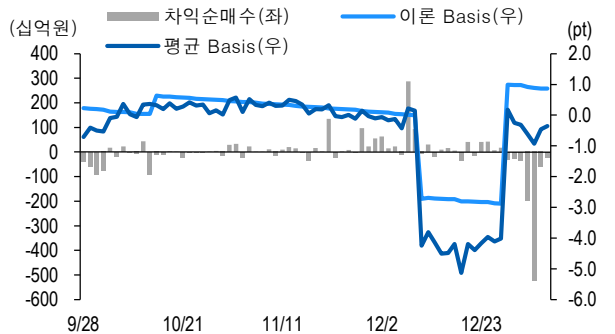
선물옵션시장 지표

2022.1.10

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	390.85	1.20	4.63	7,765.3	-
선물 3월물	390.50	1.36	5.25	23,565.8	251,752
선물 6월물	390.75	1.38	5.30	30.4	10,223
1월물(mini)	390.42	1.37	5.26	1,952.8	96,832
2월물(mini)	390.24	1.36	5.24	13.3	12,868

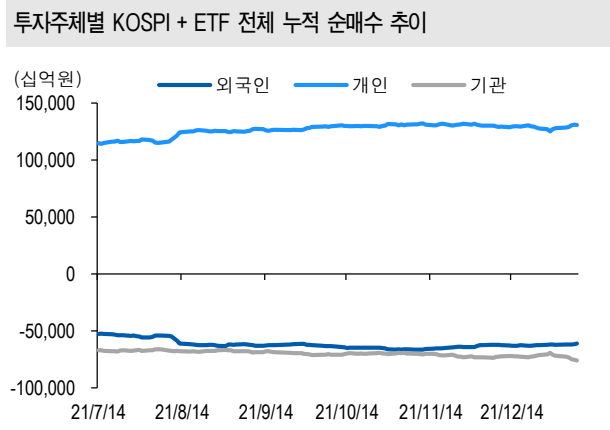


	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.86	-0.36	-0.35	-0.31%
베이스(mini)	0.08	-0.54	-0.43	-0.16%
제1스프레드(SP)	0.65	0.22	0.20	-0.11%
합성선물 베이스(ATM)	0.08	-0.45	-0.45	-0.14%

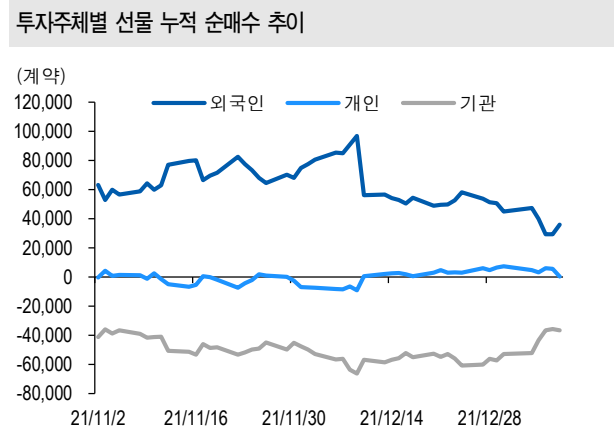


	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	634.8	14.7	649.5	0.0	316.0	653.6	-5.5	0.5	-14.5	-12.6
개인	-243.8	7.6	-236.2	0.0	38.2	-454.1	-57.2	-1.5	15.1	-80.6
기관	-375.7	-15.8	-391.5	-22.7	-134.1	-127.4	58.0	0.4	-0.3	93.6
금융투자	-395.2	46.8	-348.5	-54.0	-34.7	-484.1	53.0	0.4	-0.4	161.0
투신	43.0	-77.1	-34.1	0.0	-7.5	419.7	3.5	0.1	-0.1	-84.8
은행+보험+기타금융	4.7	10.9	15.6	0.0	-15.8	-36.9	1.4	0.0	0.2	0.2
연기금+국가자재	-63.9	-31.5	-95.5	31.2	-45.1	-26.2	0.0	0.0	0.0	17.2
기타법인	-15.3	-6.4	-21.7	0.0	7.3	-72.1	4.7	0.5	-0.4	-0.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



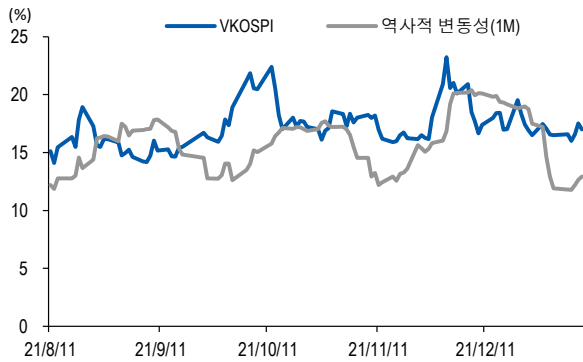
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,541,662	399.7	929,973	13.2%	지수옵션 전체	2,930,881	719.4	2,422,782
Put	1,389,219	319.7	1,492,809	17.8%	PCR(금액기준)	0.80	VKOSPI	16.99%(-0.53%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	392.5(K+3)	2.15	1.21	218,256	16,763	-1,488	13.2	Put	387.5(K+1)	2.07	-2.77	81,359	20,048	1,765	16.4
	390.0(K+2)	3.38	1.78	103,600	13,771	527	13.4		385.0(K+0)	1.40	-2.16	130,303	24,745	3,574	16.9
	387.5(K+1)	4.96	2.41	23,962	8,198	967	13.6		382.5(K-1)	0.95	-1.65	152,286	19,040	1,527	17.6
	385.0(K+0)	6.80	3.02	7,059	3,185	240	13.6		380.0(K-2)	0.61	-1.26	179,074	33,974	2,637	18.0
	382.5(K-1)	8.87	3.55	2,764	1,089	64	13.4		377.5(K-3)	0.42	-0.91	135,757	20,725	-490	18.9

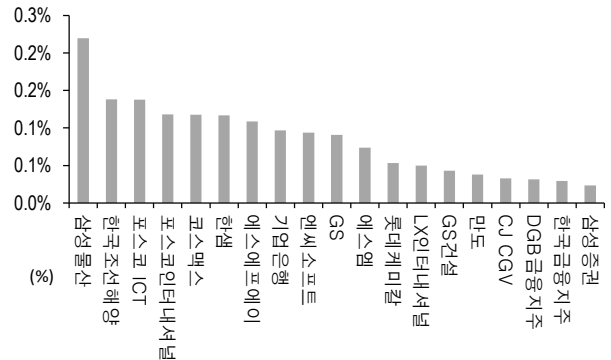
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	3,280,404	3,171.4	5,691,066	-15,750	22,390	-53,689	31,266	-12.6	-80.6	93.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
대한항공	28,600	0.70	31.2	87.7	129,176	-20,012	-0.09%	6,819	-1,723	-5,096	15,828	1,474
LG 이노텍	337,000	2.12	153.3	78.7	18,918	-3,203	-0.09%	887	-2,388	1,558	1,316	1,955
LG 전자	138,000	1.85	78.1	71.2	52,948	2,104	-0.04%	2,144	-1,820	-465	-808	-1,864
SK 하이닉스	126,500	0.80	272.4	65.6	261,503	-16,107	-0.16%	-6,207	-5,535	11,828	16,437	-2,477
삼성전자	78,000	1.30	744.8	63.1	1,347,230	-90,120	-0.21%	-38,463	16,171	22,292	64,149	18,550
삼성전기	187,500	3.31	79.6	62.9	33,626	-8,253	-0.26%	-981	-2,569	3,480	5,548	2,165
SK 이노베이션	246,000	-0.81	64.6	59.1	32,198	-3,244	-0.16%	-971	535	433	1,075	599
엔씨소프트	607,000	1.17	44.1	57.8	14,659	121	0.09%	515	-242	-273	22	-1,153
현대차	215,500	0.70	70.4	56.8	51,550	1,766	0.00%	-1,439	1,959	-520	306	-2,123
삼성 SDI	636,000	0.16	90.6	56.5	32,007	-3,020	-0.18%	-626	-2,446	3,060	2,181	1,854

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터