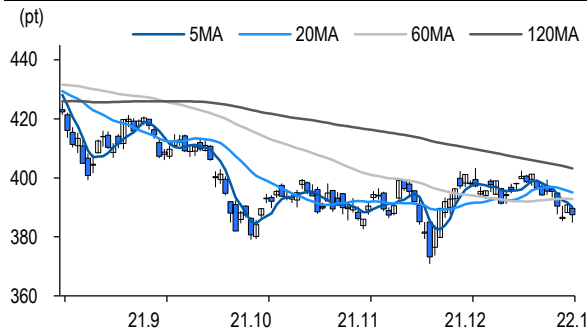


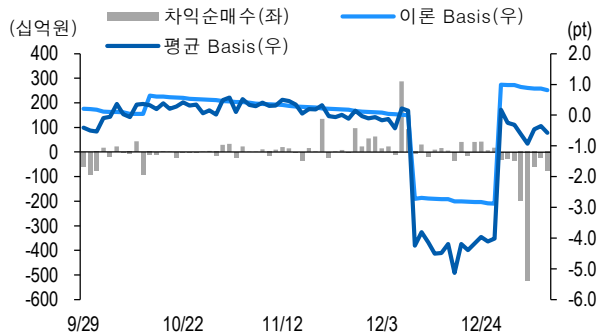
선물옵션시장 지표

2022.1.11

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	387.52	-0.85	-3.33	8,164.4	-
선물 3월물	386.70	-0.97	-3.80	25,999.9	253,151
선물 6월물	386.95	-0.97	-3.80	24.9	10,336
1월물(mini)	386.80	-0.93	-3.62	1,865.6	101,411
2월물(mini)	386.70	-0.91	-3.54	21.0	13,644

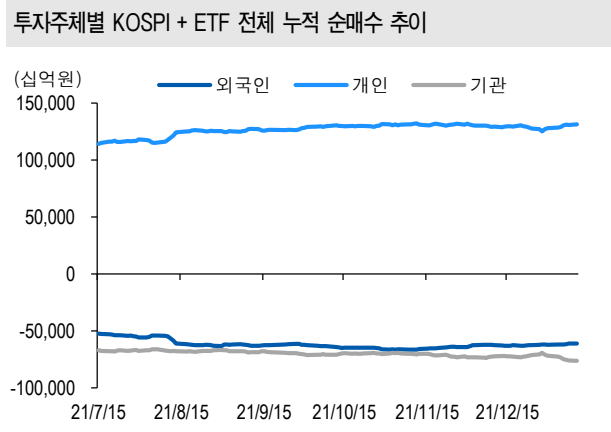


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.81	-0.57	-0.82	-0.36%
베이스(mini)	0.04	-0.54	-0.72	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.64	0.27	0.25	-0.10%
합성선물 베이스(ATM)	0.04	-0.78	-0.78	-0.21%

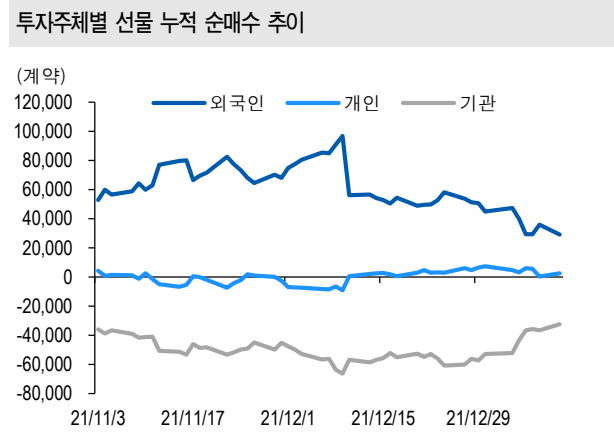


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-82.1	-20.1	-102.2	-0.2	141.7	-663.2	4.8	-0.7	1.2	34.4
개인	573.2	5.2	578.5	0.0	16.0	208.8	18.4	-0.6	0.4	-89.5
기관	-500.1	13.2	-486.8	-77.2	-41.1	423.1	-27.1	2.2	-1.0	55.3
금융투자	-287.3	-38.1	-325.4	-77.2	-0.5	607.8	-26.3	2.8	-2.0	168.3
투신	-16.8	9.4	-7.5	0.0	-9.7	-202.5	-0.2	-0.7	0.1	-120.6
은행+보험+기타금융	-2.3	17.8	15.5	0.0	-1.0	-5.6	-0.6	0.0	0.9	-0.8
연기금+국가지자체	-134.3	2.6	-131.7	0.0	-15.2	23.3	0.0	0.0	0.0	8.3
기타법인	8.9	1.6	10.5	0.0	3.5	31.3	3.9	-0.8	-0.6	-0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,546,518	301.4	972,828	15.5%	지수옵션 전체	3,240,183	744.3	2,483,756
Put	1,693,665	442.9	1,510,928	20.4%	PCR(금액기준)	1.47	VKOSPI	17.41%(+0.42%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	397.5(K+3)	0.20	-0.48	157,567	28,130	2,173	16.2	Put	392.5(K+1)	6.53	2.28	4,867	8,221	-629	21.7
	395.0(K+2)	0.37	-0.89	308,499	31,776	4,116	15.4		390.0(K+0)	4.71	1.72	17,046	16,783	4	20.7
	392.5(K+1)	0.78	-1.37	250,428	23,308	6,545	15.4		387.5(K-1)	3.17	1.10	48,298	19,116	-932	19.8
	390.0(K+0)	1.45	-1.93	236,744	19,506	5,735	15.2		385.0(K-2)	2.10	0.70	168,375	23,101	-1,644	20.0
	387.5(K-1)	2.46	-2.50	123,512	11,840	3,642	15.0		382.5(K-3)	1.34	0.39	178,378	19,527	487	20.3

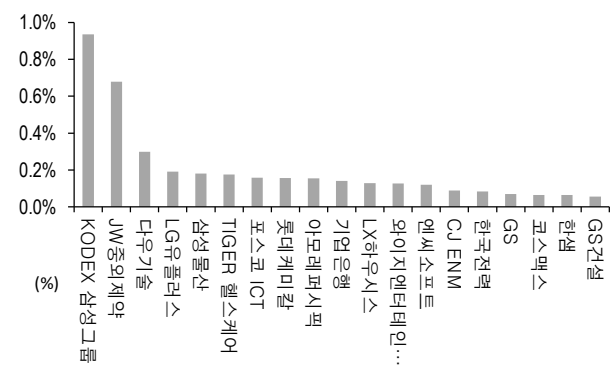
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 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	3,792,161	3,740.6	5,676,600	-14,466	55,673	-87,985	32,560	34.4	-89.5	55.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	332,000	-1.48	123.0	97.7	13,417	-5,501	-0.12%	-1,071	155	885	4,343	1,211
엔씨소프트	614,000	1.15	59.8	97.2	14,120	-539	0.12%	-436	-84	520	-276	-817
현대차	209,500	-2.78	151.1	96.6	41,017	-10,533	-0.11%	2,539	-11,623	9,084	6,141	2,427
SK 하이닉스	124,500	-1.58	364.0	87.3	231,676	-29,827	-0.16%	-3,741	-9,225	13,004	23,035	6,950
POSCO	302,500	-0.66	73.6	80.1	23,001	-2,065	-0.04%	-70	-540	551	-310	425
삼성전기	181,500	-3.20	79.0	79.5	20,677	-12,949	-0.20%	1,562	913	-2,339	6,339	218
삼성전자	78,000	0.00	574.0	76.6	1,211,599	-135,631	-0.14%	21,148	-14,692	-6,532	27,466	-16,100
SK 이노베이션	244,000	-0.81	44.2	66.4	28,338	-3,860	-0.15%	-21	-649	620	459	701
LG 전자	130,000	-5.80	153.4	66.2	33,403	-19,545	-0.29%	47	-9,895	9,992	20,795	6,353
기아	83,900	-3.12	99.8	65.2	60,337	-18,673	-0.09%	-190	4,082	-3,892	8,383	5,053

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터