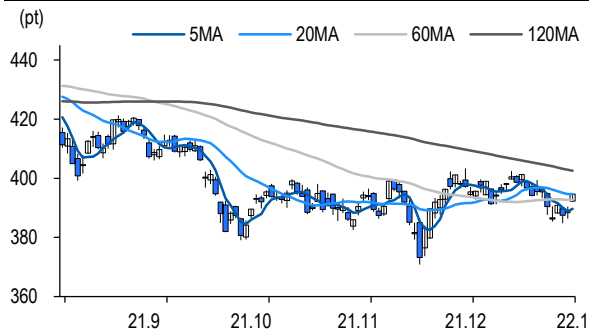


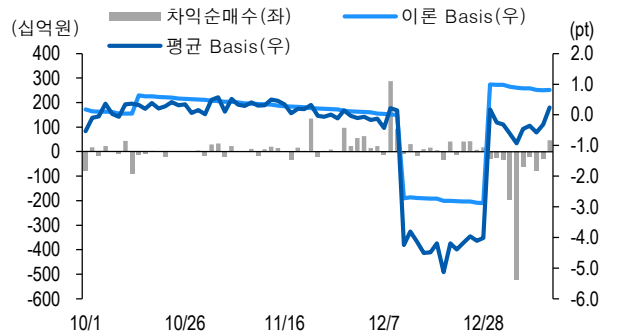
선물옵션시장 지표

2022.1.13

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	394.66	1.46	5.69	8,734.7	-
선물 3월물	395.00	1.73	6.70	21,741.3	247,121
선물 6월물	395.25	1.71	6.65	25.0	10,364
1월물(mini)	394.86	1.68	6.52	1,818.7	90,064
2월물(mini)	394.76	1.68	6.54	54.2	21,620

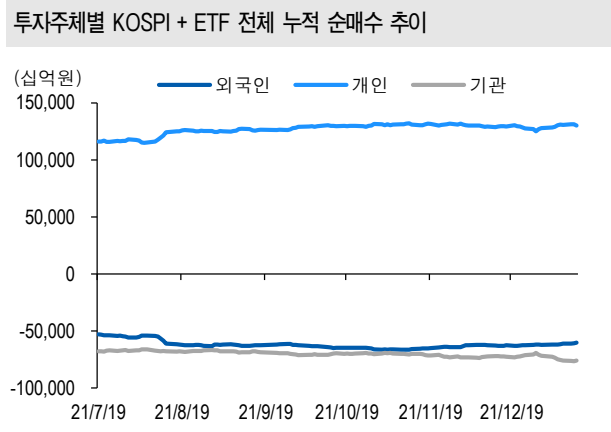


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.81	0.24	0.34	-0.14%
베이스스(mini)	0.01	0.06	0.20	0.01%
제1스프레드(SP)	0.66	0.23	0.25	-0.11%
합성선물 베이스스(ATM)	0.01	0.13	0.13	0.03%

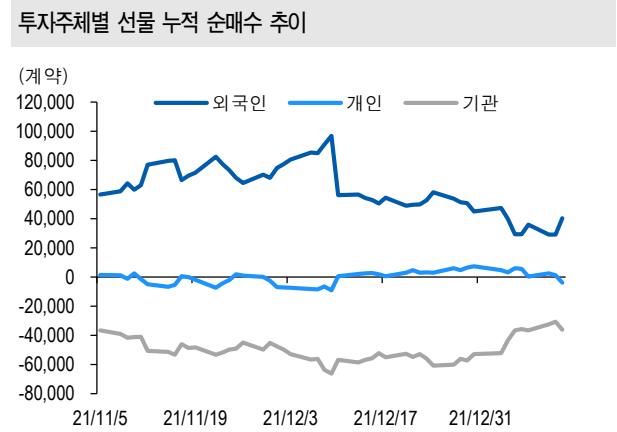


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	451.6	-3.4	448.2	10.1	216.3	1,266.8	-176.1	1.3	-3.8	54.9
개인	-1,069.6	-54.1	-1,123.7	0.0	9.2	-393.0	-109.7	1.0	2.0	28.0
기관	605.8	55.8	661.6	36.5	-162.9	-839.5	287.4	-2.2	2.3	-83.5
금융투자	595.6	108.3	704.0	2.2	4.8	-1,263.5	287.6	-2.0	2.5	-63.2
투신	16.1	-13.9	2.2	3.9	-45.3	455.9	-0.2	-0.2	-0.1	11.9
은행+보험+기타금융	-38.7	-13.3	-52.0	-0.9	-84.5	-11.5	0.0	0.0	0.0	-0.3
연기금+국가지자체	32.3	-27.2	5.1	31.3	-32.7	-20.4	0.0	0.0	0.0	-31.9
기타법인	12.2	1.8	14.0	0.0	2.0	-34.3	-1.6	-0.1	-0.6	0.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,489,034	349.4	1,006,168	13.9%	지수옵션 전체	3,050,651	569.2	2,686,004
Put	1,561,617	219.8	1,679,836	16.5%	PCR(금액기준)	0.63	VKOSPI	15.91%(-1.36%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	397.5(K+3)	0.55	0.42	404,926	32,821	963	13.4	Put	392.5(K+1)	0.73	-4.18	163,691	20,968	12,424	13.7
	395.0(K+2)	1.47	1.16	362,837	25,839	-7,850	13.9		390.0(K+0)	0.29	-2.92	263,881	28,716	12,147	14.6
	392.5(K+1)	3.01	2.23	176,409	18,784	-3,985	14.6		387.5(K-1)	0.12	-1.87	272,429	31,494	10,195	16.0
	390.0(K+0)	5.08	3.49	49,471	16,571	-3,703	16.2		385.0(K-2)	0.07	-1.11	222,853	35,618	10,828	18.3
	387.5(K-1)	7.43	4.56	11,819	12,167	-787	18.9		382.5(K-3)	0.04	-0.60	125,043	27,303	5,478	20.4

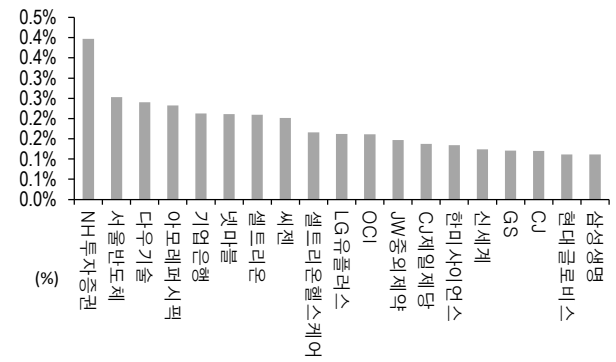
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,916,732	3,753.3	5,800,557	125,911	102,034	-1,290	-102,502	54.9	28.0	-83.5

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
대한항공	28,500	1.24	37.1	87.8	51,472	-41,945	-0.11%	8,278	-1,104	-7,176	20,879	3,338
SK 하이닉스	128,500	0.39	398.1	87.8	187,240	-31,871	-0.23%	2,674	23	-3,042	6,958	-150
엔씨소프트	617,000	1.65	58.3	83.3	6,894	-2,220	0.10%	193	-82	-113	-707	330
현대차	212,000	0.71	67.8	68.4	32,609	-7,858	-0.02%	613	-1,702	1,239	1,890	-377
LG 이노텍	344,500	5.51	142.2	61.5	12,643	-609	0.00%	104	264	-368	-346	-22
POSCO	306,500	2.17	61.7	61.2	18,876	-4,879	0.03%	-513	358	224	277	-53
GS 건설	44,000	0.46	17.5	54.1	21,783	-10,483	0.05%	-1,156	-610	1,570	-305	1,875
LG 전자	137,000	4.98	122.7	51.5	22,215	-1,860	-0.08%	2,624	1,129	-3,643	-134	-3,344
LG 디스플레이	24,300	-0.21	38.6	51.5	133,157	-31,751	-0.23%	1,731	2,517	-4,868	208	-5,230
기아	85,100	1.31	44.1	48.8	49,075	-1,035	0.04%	6,088	5,130	-11,218	-8,729	-3,989

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터