

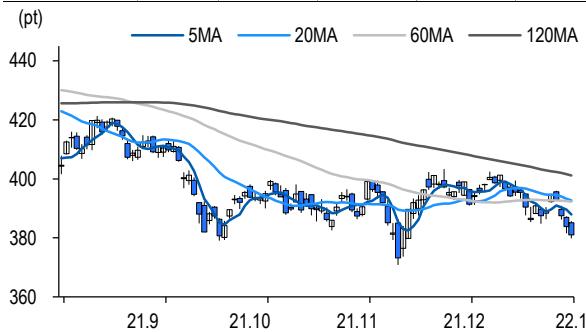


선물옵션시장 지표

2022.1.19

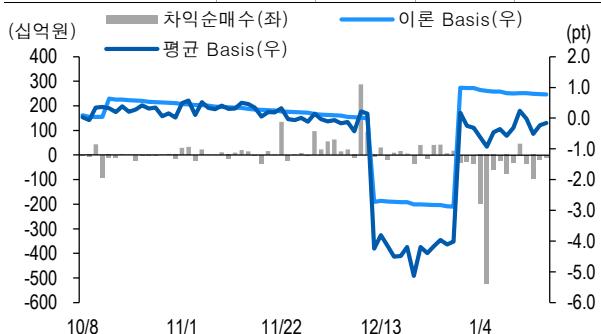
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	381.01	-0.73	-2.80	7,112.1	-
선물 3월물	380.65	-0.95	-3.65	26,418.5	256,871
선물 6월물	380.90	-0.95	-3.65	32.6	10,798
2월물(mini)	380.56	-0.97	-3.74	1,819.8	42,918
3월물(mini)	380.42	-1.01	-3.88	3.0	3,109



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.77	-0.16	-0.36	-0.24%
베이시스(mini)	0.35	-0.21	-0.45	-0.15%
제1스프레드(SP)	0.74	0.31	0.35	-0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	0.35	-0.56	-0.56	-0.24%



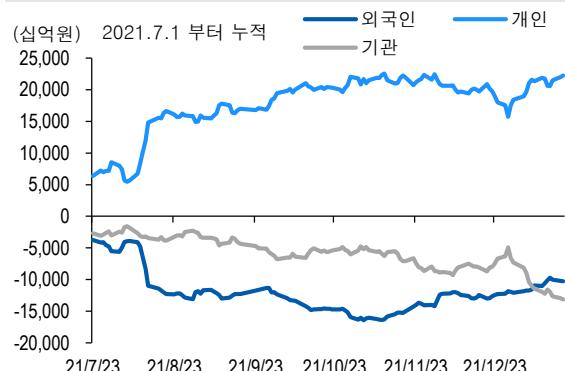
투자주체별 매매 동향

(십억원)

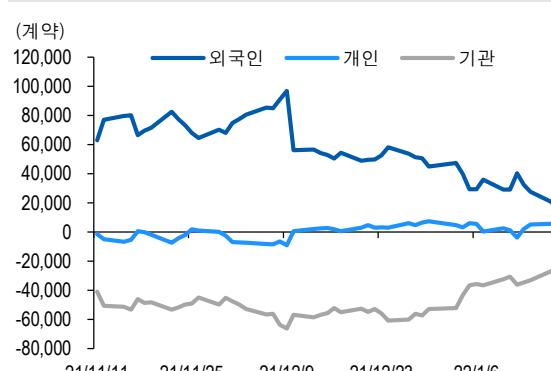
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	7.4	-27.3	-19.9	0.0	-33.2	-534.0	0.0	-3.9	1.2	16.8
개인	207.8	29.8	237.6	0.0	8.0	128.4	15.8	2.3	-0.4	-26.3
기관	-226.9	-2.9	-229.8	-10.7	-34.2	393.7	-16.4	1.6	-1.3	9.6
금융투자	-33.2	-27.5	-60.7	-8.6	0.0	229.1	-15.1	1.6	-0.5	16.8
투신	-58.7	-27.1	-85.8	0.0	-10.6	203.4	-0.5	-0.1	0.0	2.7
은행+보험+기타금융	-30.1	30.6	0.5	0.0	-15.0	10.7	-0.9	0.0	-0.7	0.1
연기금+국가지자체	-37.6	11.6	-26.0	-1.9	-9.0	-49.4	0.0	0.0	0.0	-10.0
기타법인	11.7	0.5	12.1	0.0	2.4	11.9	0.6	0.0	0.5	0.0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	687,040	213.7	593,767	14.6%	지수옵션 전체	1,469,797	511.1	1,579,701
Put	782,757	297.4	985,934	17.9%	PCR(금액기준)	1.39	VKOSPI	18.16%(+0.63%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	392.5(K+3)	1.86	-0.96	48,319	7,907	2,581	14.7	387.5(K+1)
	390.0(K+2)	2.50	-1.20	40,853	9,705	1,673	14.8	385.0(K+0)
	387.5(K+1)	3.29	-1.45	16,888	3,690	730	14.9	382.5(K-1)
	385.0(K+0)	4.24	-1.71	10,933	3,850	1,059	15.0	380.0(K-2)
	382.5(K-1)	5.36	-1.99	3,856	1,754	774	15.1	377.5(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	387.5(K+1)	10.25	2.27	1,547	6,451	-217	17.2	385.0(K+0)
	385.0(K+0)	8.79	2.12	3,969	17,402	300	17.4	382.5(K-1)
	382.5(K-1)	7.36	1.77	5,556	8,256	381	17.4	380.0(K-2)
	380.0(K-2)	6.17	1.53	13,927	11,547	607	17.6	377.5(K-3)
	377.5(K-3)	5.29	1.49	16,933	6,122	-19	18.2	

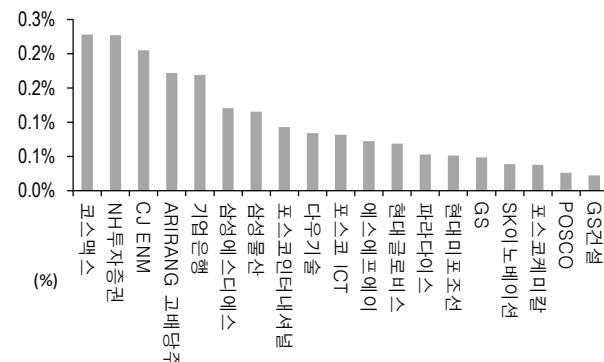
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,453,143	2,915.4	4,859,004	171,201	8,158	-68,127	61,244	16.8	-26.3	9.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전자	77,100	-0.39	731.3	99.1	1,260,771	5,051	-0.13%	19,884	-7,366	-12,433
LG 화학	694,000	-1.70	141.0	87.0	14,869	565	-0.21%	10	-245	252
엔씨소프트	578,000	-2.03	31.8	67.1	11,634	66	-0.06%	64	18	-82
SK 하이닉스	127,000	-0.39	297.3	65.4	166,598	-365	0.01%	-2,635	2,363	-708
POSCO	286,000	-2.22	60.6	65.0	24,219	1,517	0.03%	668	729	-1,526
LG 전자	138,500	-1.77	114.4	61.8	38,081	1,721	-0.04%	-2,245	3,292	-1,017
LG 이노텍	359,000	-0.42	128.1	60.9	15,289	-1,221	-0.03%	420	-1,034	631
삼성전기	192,000	4.07	167.4	60.1	31,132	4,465	-0.01%	4,097	-1,244	-2,738
현대제철	42,300	-2.08	12.7	58.7	9,713	-1,871	-0.05%	384	-1,310	926
대한항공	28,100	-0.88	16.8	58.3	65,076	-567	-0.05%	-2,315	-2,078	4,393

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터