

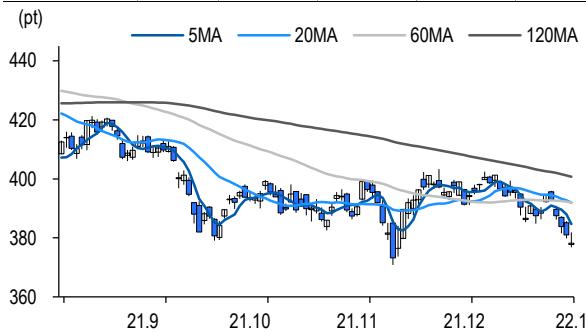


선물옵션시장 지표

2022.1.20

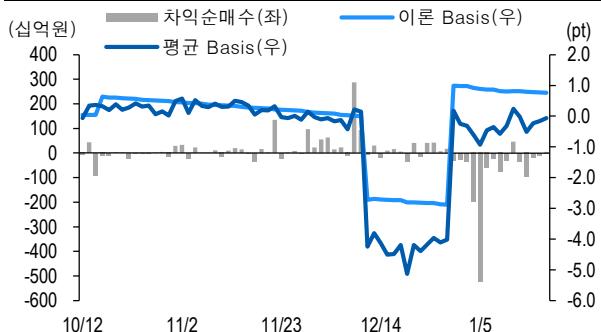
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	378.21	-0.73	-2.80	7,564.9	-
선물 3월물	378.00	-0.70	-2.65	26,780.0	254,666
선물 6월물	378.40	-0.66	-2.50	20.6	10,791
2월물(mini)	378.14	-0.64	-2.42	2,289.0	45,446
3월물(mini)	378.02	-0.69	-2.40	7.4	3,410



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.76	-0.06	-0.21	-0.22%
베이시스(mini)	0.33	0.00	-0.07	-0.09%
제1스프레드(SP)	0.74	0.31	0.30	-0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	0.33	-0.01	-0.01	-0.09%



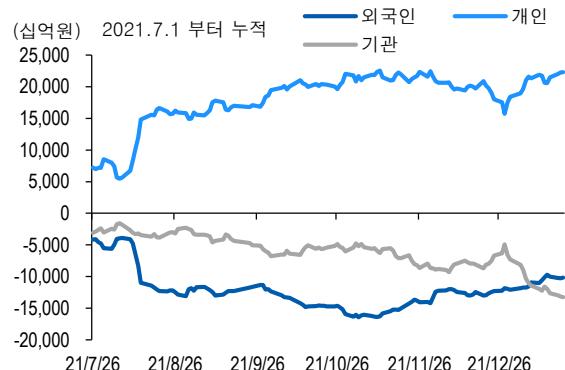
투자주체별 매매 동향

(십억원)

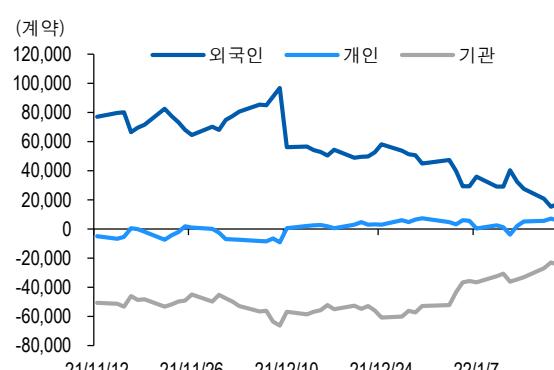
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	27.2	37.2	64.4	1.8	54.7	11.9	185.1	-1.0	44.5	29.5
개인	-29.2	76.6	47.5	0.0	0.7	-111.9	-26.9	-0.6	-39.0	-114.2
기관	-4.7	-110.3	-114.9	2.5	-81.2	23.3	-159.2	2.0	-5.8	86.7
금융투자	161.2	-100.5	60.8	8.3	-0.5	-125.5	-162.2	4.0	-5.8	77.8
투신	-27.4	-11.0	-38.4	0.0	-19.8	131.6	2.6	-0.1	0.2	-1.8
은행+보험+기타금융	-30.1	-6.9	-37.0	0.0	-28.7	14.8	0.3	-1.9	-0.2	0.2
연기금+국가지자체	-119.2	11.2	-108.1	-5.8	-32.9	2.4	0.0	0.0	0.0	10.4
기타법인	6.6	-3.5	3.1	0.0	0.5	76.6	1.1	-0.3	0.2	-1.9

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	759,128	234.3	637,679	15.3%	지수옵션 전체	1,602,257	587.1	1,643,235							
Put	843,129	352.8	1,005,556	17.7%	PCR(금액기준)	1.51	VKOSPI	18.76%(+0.60%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	387.5(K+3)	2.48	-0.81	52,539	7,123	3,433	15.4	Put	382.5(K+1)	8.56	1.20	7,088	6,137	-2,119	16.8
	385.0(K+2)	3.26	-0.98	28,314	5,805	1,955	15.5		380.0(K+0)	7.22	1.05	9,506	11,478	-69	17.1
	382.5(K+1)	4.23	-1.13	8,511	2,642	888	15.8		377.5(K-1)	6.05	0.76	10,242	6,634	512	17.4
	380.0(K+0)	5.42	-1.27	11,525	3,641	2,642	16.1		375.0(K-2)	5.07	0.77	14,589	14,526	-1,004	17.8
	377.5(K-1)	6.69	-1.44	3,044	1,639	1,381	16.3		372.5(K-3)	4.19	0.63	19,632	12,105	61	18.1

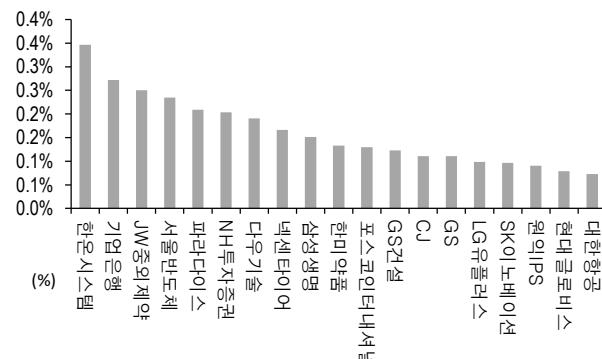
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,074,586	3,477.8	4,944,476	85,472	106,743	-172,993	71,678	29.5	-114.2	86.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
SK 하이닉스	127,000	0.00	506.1	97.9	154,823	-11,775	-0.11%	-2,732	-7,154	10,805
삼성전자	76,100	-1.30	689.4	85.4	1,207,324	-53,447	-0.19%	-7,917	-83,648	94,490
삼성전기	187,500	-2.34	130.8	82.2	33,854	2,722	-0.12%	-2,149	-7,118	9,225
한국금융지주	77,700	-0.26	8.9	68.4	20,397	752	0.05%	533	-54	-479
호텔신라	73,900	-0.40	17.4	67.4	19,293	3,676	-0.12%	2,193	-255	-1,938
LG 전자	136,500	-1.44	122.0	67.2	37,434	-647	-0.06%	1,033	-725	-427
현대위아	71,300	-1.38	8.1	66.7	5,991	991	-0.31%	272	-1,856	1,584
LG 화학	650,000	-6.34	191.9	66.6	15,881	1,012	-0.21%	-306	-368	422
KB 금융	61,600	0.49	58.0	65.1	91,229	13,742	-0.35%	6,868	-19,885	13,017
GS 건설	40,700	0.99	18.7	64.9	44,692	3,517	0.12%	-2,619	1,230	1,589

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터