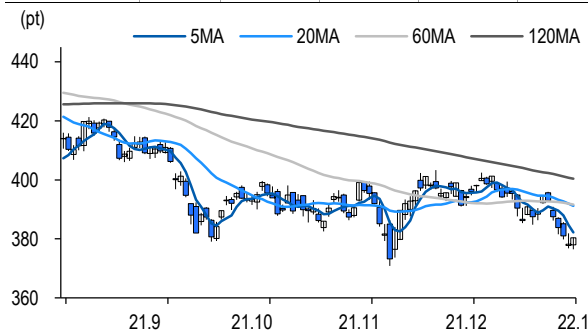


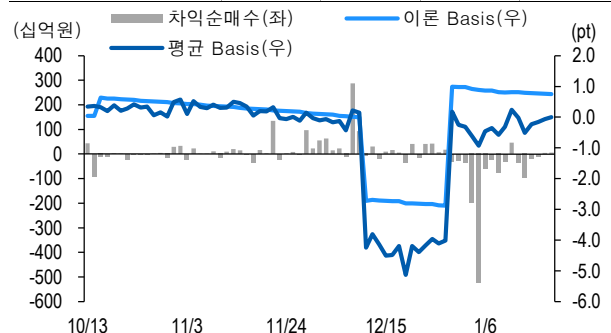
## 선물옵션시장 지표

2022.1.21

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	380.39	0.58	2.18	6,850.6	-
선물 3월물	380.05	0.54	2.05	25,420.9	253,667
선물 6월물	380.20	0.48	1.80	14.8	10,791
2월물(mini)	380.12	0.52	1.98	2,096.1	47,179
3월물(mini)	380.00	0.53	1.98	3.5	3,500



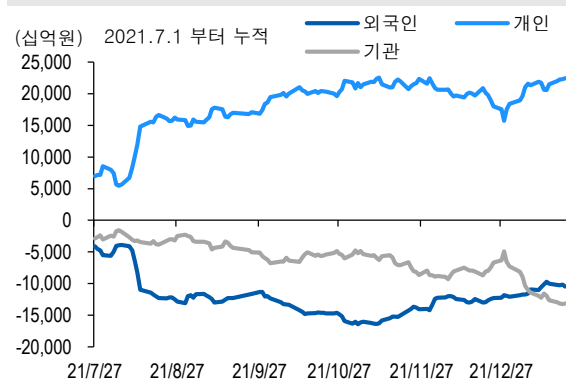
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.75	0.00	-0.34	-0.20%
베이스(mini)	0.32	0.05	-0.27	-0.07%
제1스프레드(SP)	0.75	0.30	0.30	-0.12%
합성선물 베이스(ATM)	0.32	-0.25	-0.25	-0.15%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-274.2	-6.6	-280.8	3.5	-250.6	-179.7	-38.5	-0.5	-0.4	24.9
개인	146.0	13.7	159.8	0.0	0.6	-83.1	-9.7	-0.4	-0.5	42.8
기관	105.7	-10.5	95.2	2.5	-97.1	303.0	52.8	1.2	0.8	-67.4
금융투자	287.3	11.8	299.1	2.5	-10.4	-106.8	53.0	1.5	1.5	-57.8
투신	-19.9	-17.3	-37.2	0.0	-18.3	434.6	-0.8	-0.1	-0.2	20.9
은행+보험+기타금융	1.0	-0.5	0.5	0.0	-2.4	-26.6	0.6	-0.1	-0.5	-0.7
연기금+국가지자체	-102.0	-10.8	-112.9	-0.1	-60.1	1.8	0.0	0.0	0.0	-29.8
기타법인	22.5	3.4	25.8	0.0	1.4	-40.2	-4.6	-0.2	0.0	-0.3

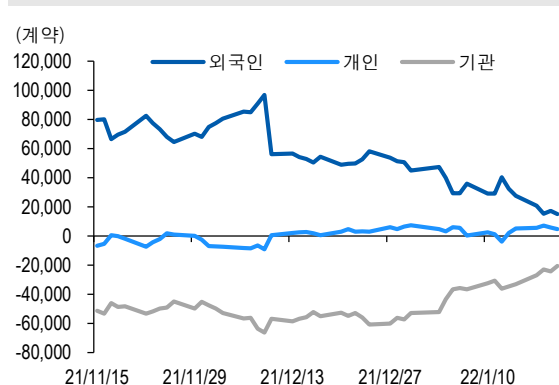
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	655,326	231.4	664,741	14.7%	지수옵션 전체	1,310,272	483.2	1,690,876
Put	654,946	251.8	1,026,135	17.8%	PCR(금액기준)	1.09	VKOSPI	17.99%(-0.77%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	385.0(K+3)	3.63	0.37	37,070	8,144	2,339	14.7	Put	380.0(K+1)	5.87	-1.35	7,115	11,929	451	16.7
	382.5(K+2)	4.72	0.49	11,579	3,738	1,096	14.9		377.5(K+0)	4.83	-1.22	8,712	7,384	750	17.0
	380.0(K+1)	6.03	0.61	10,102	4,217	576	15.2		375.0(K-1)	3.94	-1.13	12,875	14,198	-328	17.3
	377.5(K+0)	7.47	0.78	3,355	1,874	235	15.4		372.5(K-2)	3.21	-0.98	16,205	12,400	295	17.7
	375.0(K-1)	9.03	0.88	2,452	930	297	15.5		370.0(K-3)	2.61	-0.85	39,693	23,850	349	18.1

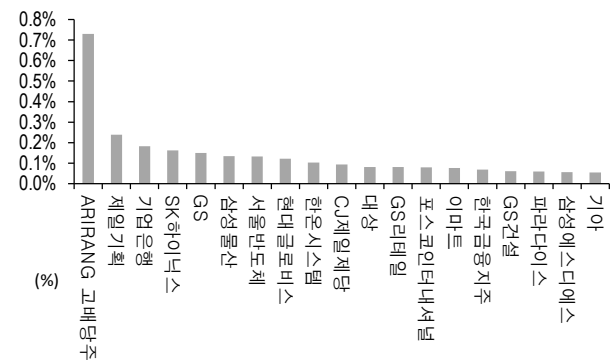
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)	
주식선물 전체		거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
		3,666,340	3,282.2	5,131,194	186,718	68,800	56,820	-125,787	24.9	42.8	-67.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	125,500	-1.18	636.7	96.1	167,484	12,661	0.16%	-1,162	524	473	-11,251	-1,600
호텔신라	74,500	0.81	17.4	86.0	22,306	3,013	-0.16%	-640	97	543	3,533	1,986
LG 화학	694,000	6.77	232.7	81.9	15,411	-470	-0.20%	1,008	-797	-209	188	87
삼성전기	189,000	0.80	85.2	77.4	31,922	-1,932	-0.01%	814	3,490	-4,329	-1,136	-2,502
POSCO	286,500	0.35	85.3	77.2	24,049	-1,285	0.04%	-1,228	-51	1,279	122	1,157
LG 이노텍	376,500	0.80	148.7	76.2	15,806	-277	-0.05%	-446	500	17	-1,283	1,301
하나금융지주	45,400	-3.09	40.4	73.0	92,308	3,450	0.00%	-3,697	6,547	-3,970	-2,064	-1,906
삼성전자	76,500	0.53	500.2	69.3	1,220,572	13,248	-0.09%	-359	17,019	-16,430	1,198	-31,148
SK 이노베이션	266,000	1.33	154.1	68.7	38,245	-3,780	0.04%	1,233	-3,935	2,937	758	2,689
대한항공	28,000	1.08	10.2	61.4	63,587	-2,903	0.03%	-268	-2,103	2,371	1,163	1,218

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터