

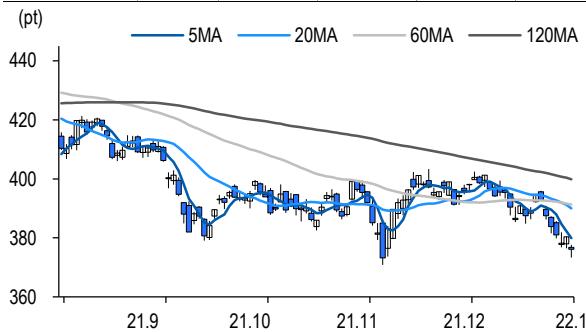


선물옵션시장 지표

2022.1.24

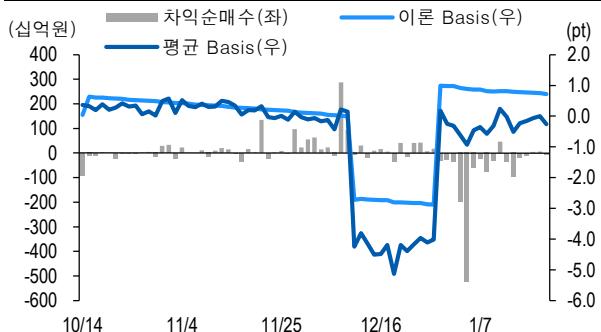
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	376.08	-1.13	-4.31	7,942.1	-
선물 3월물	376.35	-0.97	-3.70	29,730.6	259,898
선물 6월물	376.50	-0.97	-3.70	20.3	10,798
2월물(mini)	376.44	-0.97	-3.68	2,151.6	48,007
3월물(mini)	376.20	-1.02	-3.80	11.9	3,762



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.72	-0.26	0.27	-0.26%
베이시스(mini)	0.30	-0.09	0.36	-0.10%
제1스프레드(SP)	0.75	0.30	0.30	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	0.30	0.43	0.43	0.03%



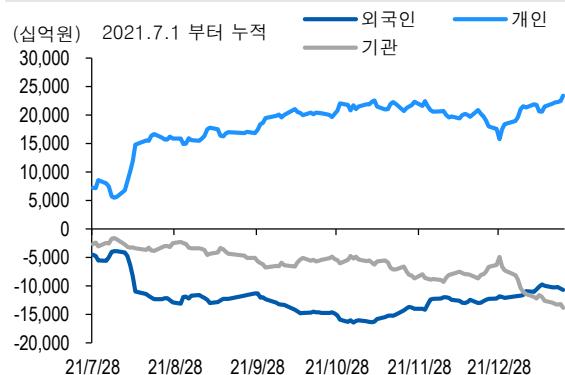
투자주체별 매매 동향

(십억원)

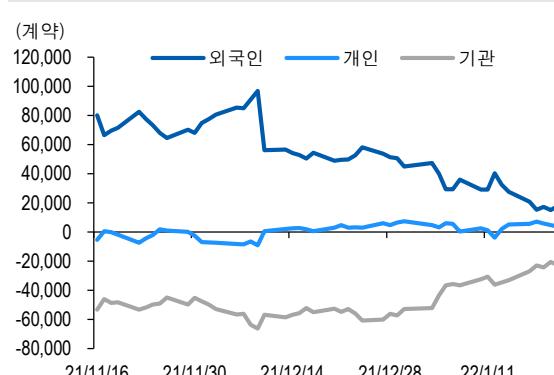
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-220.6	-20.2	-240.8	-0.4	-36.7	166.9	77.4	-2.2	4.4	-15.0
개인	896.1	68.5	964.5	0.0	3.9	-100.8	13.4	0.0	1.7	-130.1
기관	-643.6	-43.1	-686.6	-5.0	-86.3	-89.2	-92.9	2.6	-6.1	146.6
금융투자	-195.7	-90.5	-286.1	-2.2	-3.7	208.0	-91.6	2.7	-6.2	108.4
투신	-47.1	-8.8	-55.9	-4.7	3.5	-287.6	-1.3	-0.1	0.0	-6.7
은행+보험+기타금융	-55.9	39.2	-16.7	0.0	-37.8	2.3	0.0	0.0	0.0	-0.2
연기금+국가지자체	-198.1	12.5	-185.7	1.9	-57.5	-12.0	0.0	0.0	0.0	45.0
기타법인	-31.9	-5.2	-37.1	0.0	-4.1	23.1	2.1	-0.4	0.1	-1.5

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	889,426	251.5	711,574	16.0%	지수옵션 전체	1,980,321	672.3	1,788,511
Put	1,090,895	420.8	1,076,937	17.8%	PCR(금액기준)	1.67	VKOSPI	19.36%(+1.37%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	387.5(K+3)	1.88	-0.84	90,343	12,327	2,804	15.9	382.5(K+1)
	385.0(K+2)	2.59	-1.04	70,033	11,445	3,301	16.3	380.0(K+0)
	382.5(K+1)	3.44	-1.28	33,867	5,542	1,804	16.5	377.5(K-1)
	380.0(K+0)	4.48	-1.55	18,620	5,876	1,659	16.9	375.0(K-2)
	377.5(K-1)	5.70	-1.77	11,365	3,793	1,919	17.3	372.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	382.5(K+1)	9.58	2.45	1,404	6,149	-101	16.7	
	380.0(K+0)	7.97	2.10	6,041	11,331	-598	16.6	
	377.5(K-1)	6.69	1.86	6,323	7,233	-151	17.0	
	375.0(K-2)	5.60	1.66	12,500	13,911	-287	17.5	
	372.5(K-3)	4.65	1.44	15,204	11,969	-431	17.9	

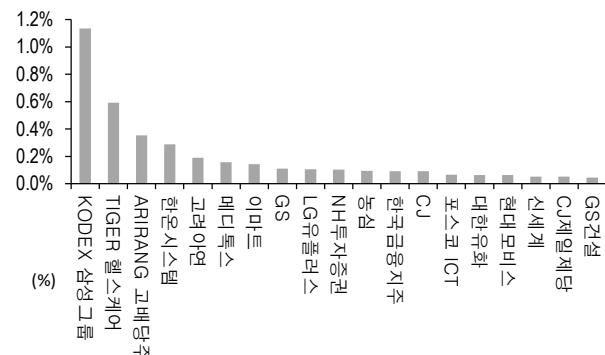
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	3,926,887	3,426.9	5,144,482	13,288	28,143	-149,633	122,821	-15.0	-130.1	146.6	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수
하나금융지주	45,500	0.22	40.9	105.5	95,174	2,866	-0.02%	3,436	-808	-2,628	-869
삼성생명	65,200	0.31	12.8	94.2	43,620	1,011	-0.03%	459	240	-699	-2,984
LG 화학	694,000	0.00	174.3	77.6	16,121	710	-0.31%	-753	0	792	1,262
LG 이노텍	364,000	-3.32	151.9	73.7	15,316	-490	-0.02%	-121	1,143	-1,029	-239
삼성전자	75,600	-1.18	869.8	73.4	1,195,549	-25,023	-0.18%	3,247	-75,786	72,250	59,954
SK 하이닉스	119,000	-5.18	506.9	69.2	161,163	-6,321	0.00%	9,461	-5,398	-3,604	1,977
NAVER	333,500	-1.04	125.8	64.9	34,065	-719	0.00%	-1,291	-222	1,534	482
한세실업	24,300	-1.22	3.5	63.9	6,400	-1,287	-0.13%	545	-768	223	223
호텔신라	75,000	0.67	12.4	62.9	24,072	1,766	-0.19%	-888	-318	1,206	3,375
POSCO	281,500	-1.75	54.3	59.8	24,979	930	0.04%	297	-427	114	745

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터