

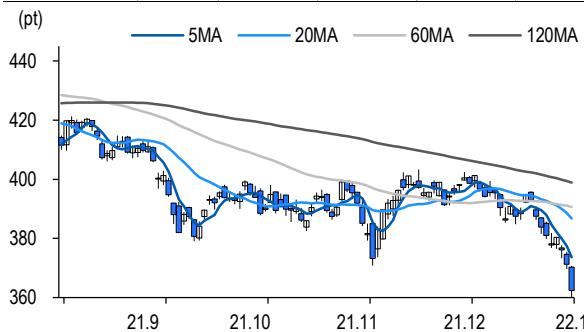


선물옵션시장 지표

2022.1.26

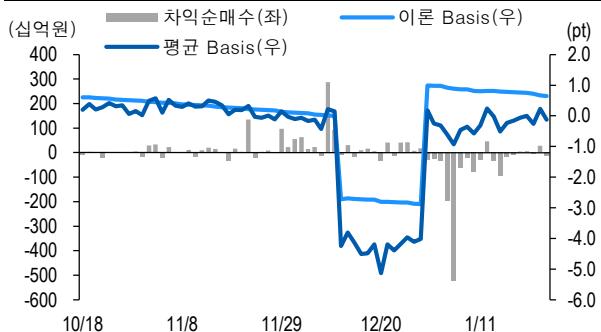
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	362.39	-2.40	-8.91	8,262.8	-
선물 3월물	361.00	-2.66	-9.85	40,623.2	277,119
선물 6월물	361.25	-2.65	-9.85	42.6	10,889
2월물(mini)	361.00	-2.68	-9.96	2,515.4	43,623
3월물(mini)	362.70	-2.20	-8.38	13.0	3,920



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.65	-0.13	-1.39	-0.21%
베이시스(mini)	0.24	0.00	-1.39	-0.06%
제1스프레드(SP)	0.70	0.30	0.30	-0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	0.24	-1.11	-1.11	-0.37%



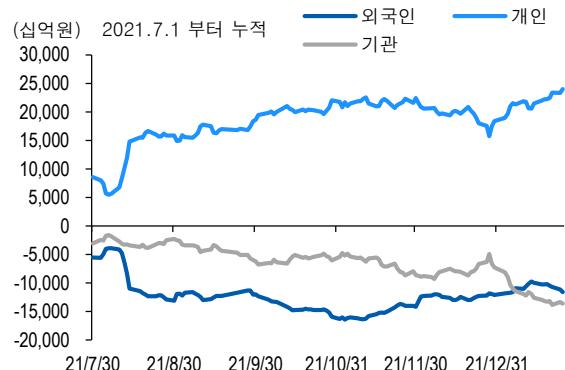
투자주체별 매매 동향

(십억원)

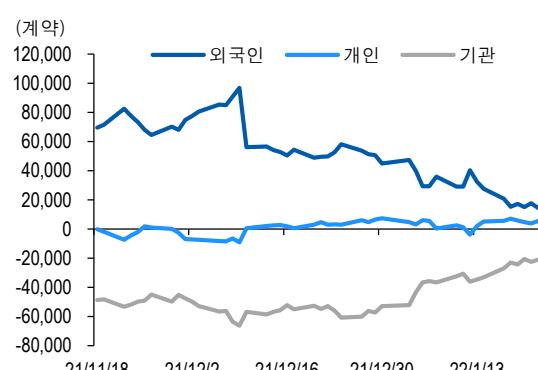
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-460.0	15.2	-444.8	-0.1	-97.3	-787.6	-32.7	-0.6	-3.7	2.5
개인	584.0	121.1	705.1	0.0	8.4	81.9	3.0	-2.1	18.3	-9.0
기관	-171.7	-146.7	-318.4	-12.8	-39.8	691.7	31.7	4.3	-17.1	4.6
금융투자	-27.8	-191.0	-218.8	0.0	-0.2	848.7	31.3	6.8	-16.0	48.0
투신	-7.2	-32.7	-40.0	0.0	7.7	-151.9	0.3	-0.2	-0.4	-33.7
은행+보험+기타금융	-2.6	64.4	61.8	0.0	-13.8	-45.0	0.1	-2.2	-0.6	0.0
연기금+국가지자체	-145.8	5.4	-140.4	-12.8	-36.7	39.8	0.0	0.0	0.0	-9.8
기타법인	47.7	10.4	58.1	0.0	1.1	14.0	-2.0	-1.7	2.4	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	1,116,896	326.6	825,704	20.5%	지수옵션 전체	2,908,742	1,143.4	1,972,108
Put	1,791,846	816.9	1,146,404	25.9%	PCR(금액기준)	2.50	VKOSPI	26.26% (+4.78%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	380.0(K+3)	1.19	-1.51	109,523	17,997	8,660	20.3	375.0(K+1)
	377.5(K+2)	1.62	-1.95	70,759	11,874	6,645	20.5	372.5(K+0)
	375.0(K+1)	2.18	-2.40	58,189	9,318	5,038	20.8	370.0(K-1)
	372.5(K+0)	2.83	-2.89	28,659	5,486	3,514	20.9	367.5(K-2)
	370.0(K-1)	3.65	-3.40	21,185	4,750	3,530	21.2	365.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	375.0(K+1)	15.05	6.44	2,607	12,950	-471	22.9	372.5(K+0)
	372.5(K+0)	14.05	6.75	1,978	11,114	-546	25.9	370.0(K-1)
	370.0(K-1)	12.35	6.26	5,327	21,836	-923	25.9	367.5(K-2)
	367.5(K-2)	10.85	5.73	6,633	10,019	-223	26.1	365.0(K-3)
	365.0(K-3)	9.47	5.27	15,226	14,893	-1,014	26.3	

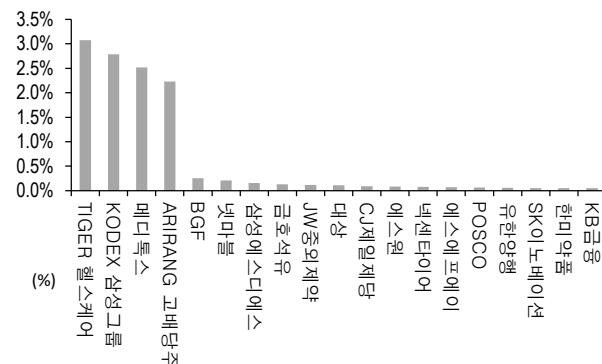
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,316,385	3,645.5	5,143,246	35,738	11,756	42,472	-55,595	2.5	-9.0	4.6
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
LG 화학	642,000	-4.32	210.7	94.0	16,636	-103	-0.14%	369	1,714	-2,134
SK 하이닉스	117,500	-0.84	514.5	77.0	157,104	-2,979	-0.07%	-1,011	807	317
LG 이노텍	348,500	-3.46	123.2	72.6	14,854	-178	0.01%	148	-294	87
현대차	194,000	-1.52	159.4	70.5	34,810	2,444	-0.09%	-2,011	-898	2,869
삼성전기	176,500	-3.29	99.2	66.8	39,355	7,559	-0.17%	-1,611	-6,978	8,581
삼성전자	73,900	-1.60	862.8	66.3	1,185,920	2,479	-0.06%	2,759	-9,596	6,880
SK 이노베이션	233,500	-5.85	110.4	65.7	31,520	470	0.05%	990	-1,664	694
하나금융지주	43,200	-2.59	38.7	65.6	105,458	5,548	0.04%	3,668	4,647	-8,383
S-Oil	86,200	-4.12	17.3	56.7	8,660	-5,736	-0.10%	1,173	-246	-911
POSCO	266,500	-2.91	65.9	55.7	26,137	1,433	0.06%	1,086	818	-2,026

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터