

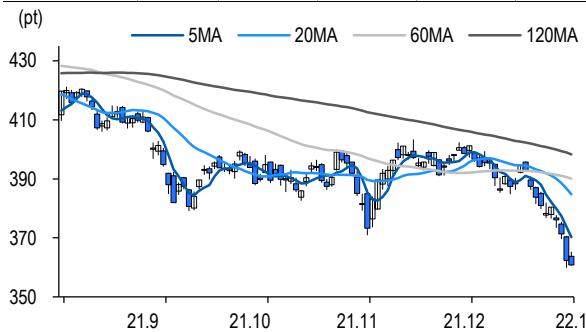


선물옵션시장 지표

2022.1.27

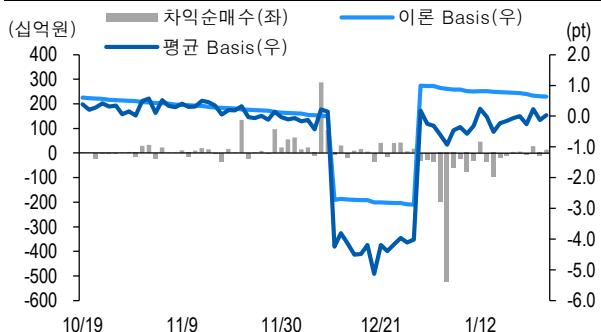
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	360.83	-0.43	-1.56	6,673.8	-
선물 3월물	360.70	-0.08	-0.30	29,698.3	271,534
선물 6월물	360.90	-0.10	-0.35	22.2	11,239
2월물(mini)	360.82	-0.05	-0.18	2,202.9	46,480
3월물(mini)	360.88	-0.03	-1.82	20.4	3,948



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.63	0.03	-0.13	-0.17%
베이시스(mini)	0.22	0.12	-0.01	-0.03%
제1스프레드(SP)	0.69	0.24	0.20	-0.13%
합성선물 베이시스(ATM)	0.22	0.00	0.00	-0.06%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-245.3	-3.8	-249.2	1.8	-180.3	20.9	6.9	-1.7	3.1	8.2
개인	225.3	70.5	295.8	0.0	-2.4	62.5	-23.1	-1.0	1.6	30.7
기관	-15.7	-73.6	-89.3	12.5	-175.5	-126.1	20.2	3.5	-5.0	-37.9
금융투자	257.1	-88.5	168.7	1.7	2.5	-446.1	20.3	3.6	-3.2	-18.5
투신	-23.4	-32.5	-55.9	0.0	-11.4	351.8	-0.1	-0.1	0.2	-6.0
은행+보험+기타금융	-86.7	75.7	-11.1	0.0	-70.9	-31.6	0.0	0.0	-2.0	-0.1
연기금+국가지자체	-160.4	-20.3	-180.6	10.8	-108.0	-0.2	0.0	0.0	0.0	-13.3
기타법인	35.7	6.9	42.6	0.0	0.5	42.6	-3.9	-0.8	0.3	-1.0

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	887,144	254.2	856,723	20.6%	지수옵션 전체	1,826,407	594.6	2,045,733
Put	939,263	340.4	1,189,010	24.0%	PCR(금액기준)	1.34	VKOSPI	24.83%(-1.43%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	370.0(K+3)	2.83	-0.82	29,261	8,055	3,305	20.7	365.0(K+1)
	367.5(K+2)	3.73	-0.82	12,063	3,297	1,217	21.2	362.5(K+0)
	365.0(K+1)	4.80	-0.84	8,401	3,692	604	21.7	360.0(K-1)
	362.5(K+0)	6.02	-0.89	4,535	1,947	669	22.2	357.5(K-2)
	360.0(K-1)	7.35	-0.95	1,400	1,503	260	22.6	355.0(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	365.0(K+1)	8.93	-0.54	5,092	15,069	176	22.4	
	362.5(K+0)	7.69	-0.56	6,513	11,001	219	23.0	
	360.0(K-1)	6.55	-0.59	12,793	18,551	1,077	23.5	
	357.5(K-2)	5.54	-0.65	9,949	13,042	-1,013	23.9	
	355.0(K-3)	4.69	-0.62	19,816	17,770	-464	24.5	

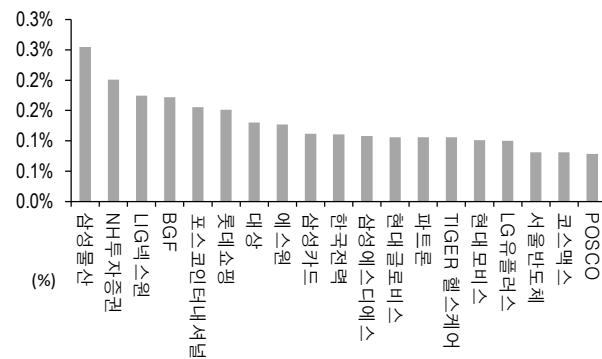
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,856,131	3,245.1	5,206,984	63,738	14,076	53,109	-65,330	8.2	30.7	-37.9

종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수
LG 화학	660,000	2.80	238.7	103.3	17,096	460	-0.16%	296	-1,233	941	-15	1,405
POSCO	270,500	1.50	71.9	94.5	24,841	-1,296	0.08%	-181	-1,191	1,287	315	972
삼성전기	175,000	-0.85	76.7	89.6	41,950	2,595	-0.16%	73	-377	301	1,093	-792
삼성전자	73,500	-0.54	827.7	87.0	1,184,309	-1,611	0.04%	-20,398	40,733	-20,323	-5,728	-10,068
현대제철	39,900	0.50	15.2	85.3	10,446	-42	-0.02%	1,975	-838	-1,137	-2,501	1,364
SK 이노베이션	232,500	-0.43	88.1	78.0	31,203	-317	0.06%	-1,877	2,150	-283	155	503
신한지주	38,250	1.73	30.3	76.6	75,428	-9,521	0.02%	155	349	-708	-2,779	76
하나금융지주	44,400	2.78	38.8	73.3	100,097	-5,361	0.02%	851	-5,053	4,202	1,246	2,073
삼성 SDI	629,000	-1.87	147.9	70.6	32,731	688	-0.05%	531	225	-758	1,135	-957
LG 이노텍	331,000	-5.02	199.5	70.5	15,105	251	0.03%	2,227	-569	-1,669	-618	-1,053

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터