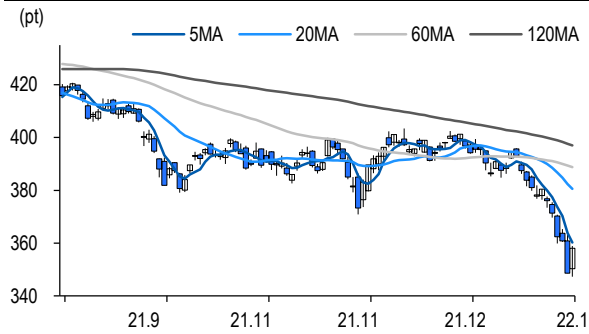


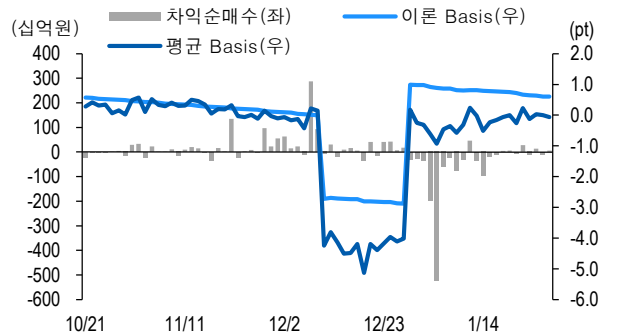
선물옵션시장 지표

2022.2.3

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	357.98	2.70	9.40	9,329.5	-
선물 3월물	356.60	2.63	9.15	39,804.3	278,027
선물 6월물	357.05	2.66	9.25	41.5	12,832
2월물(mini)	356.88	2.69	9.36	2,901.9	52,895
3월물(mini)	356.88	2.71	9.36	23.3	4,331

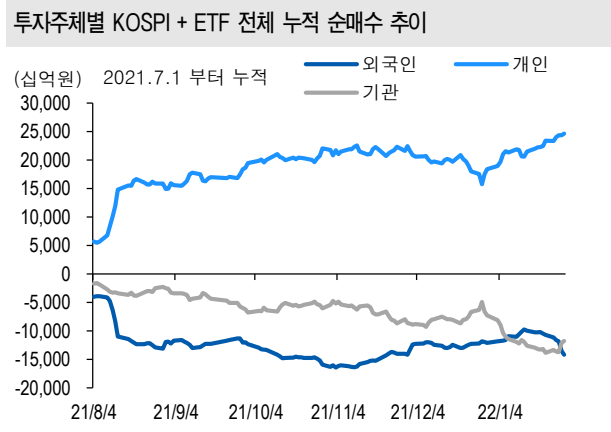


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.60	-0.06	-1.38	-0.19%
베이스(mini)	0.19	-0.03	-1.10	-0.06%
제1스프레드(SP)	0.72	0.24	0.25	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.19	-0.35	-0.35	-0.15%

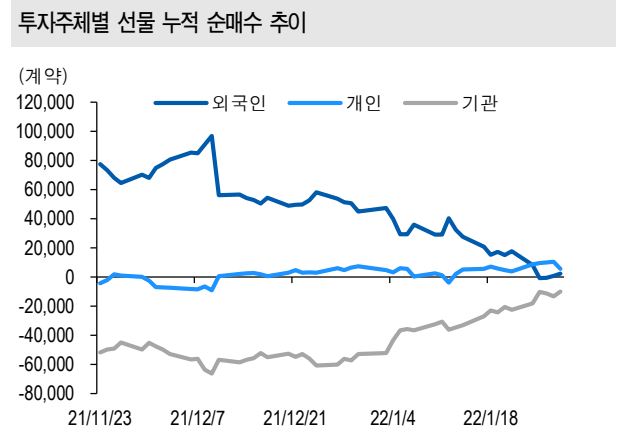


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-693.8	15.2	-678.6	6.4	-261.1	89.7	16.0	4.4	6.9	-27.5
개인	267.3	7.7	274.9	0.0	3.9	-364.4	-64.0	-3.6	-0.1	-35.8
기관	391.4	-28.5	363.0	0.0	79.0	260.0	41.1	0.2	-6.2	61.1
금융투자	51.2	-52.1	-0.9	0.5	-0.6	-429.0	40.6	0.5	-6.4	-39.5
투신	92.7	4.5	97.2	0.0	33.4	577.3	0.6	0.1	-0.2	69.6
은행+보험+기타금융	82.5	52.0	134.5	0.0	46.8	114.8	-0.1	-0.3	0.4	2.5
연기금+국가지자체	73.3	-24.1	49.2	-1.7	-16.5	-3.1	0.0	0.0	0.0	28.6
기타법인	35.1	5.6	40.7	0.0	0.0	14.7	6.9	-1.0	-0.5	2.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,422,741	494.8	1,002,169	19.4%	지수옵션 전체	3,015,293	980.4	2,277,645
Put	1,592,552	485.7	1,275,476	26.0%	PCR(금액기준)	0.98	VKOSPI	23.97%(-3.97%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	355.0(K+3)	7.09	3.07	20,918	3,813	1,399	19.2	Put	350.0(K+1)	10.35	4.24	8,090	3,184	612	19.1
	352.5(K+2)	8.66	3.67	13,214	2,765	787	19.3		347.5(K+0)	2.87	-4.42	20,324	9,317	266	25.2
	347.5(K+0)	13.00	5.58	2,996	976	299	22.7		345.0(K-1)	2.32	-3.99	47,523	20,874	-291	25.6
	345.0(K-1)	14.75	5.86	1,706	435	-37	21.8		342.5(K-2)	1.88	-3.48	44,870	17,957	1,225	26.1
										340.0(K-3)	1.54	-3.10	72,892	24,298	-1,561

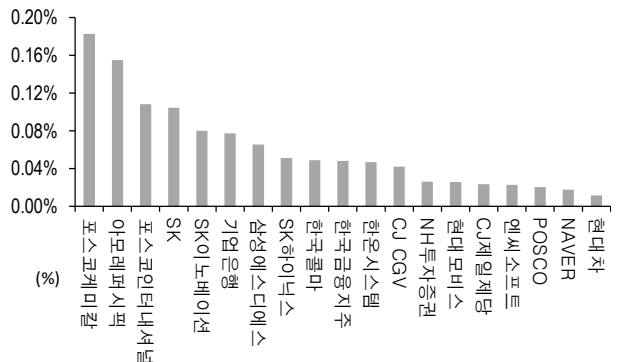
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	4,812,793	4,158.1	5,214,796	-29,922	23,513	-50,395	24,276	-27.5	-35.8	61.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
아모레퍼시픽	156,500	4.33	24.4	87.3	12,063	-1,184	0.15%	-421	446	-25	-2,626	-304
하나금융지주	45,100	2.50	51.6	85.6	94,883	-4,711	-0.05%	-8,519	-4,088	12,527	8,355	4,108
삼성전기	177,500	3.80	92.9	75.1	36,757	-1,951	-0.07%	-576	-790	1,366	2,050	-684
LG 이노텍	354,500	6.78	212.1	74.3	15,326	-2,245	-0.02%	-1,980	-1,259	3,300	-1,901	3,142
POSCO	266,000	3.10	62.1	71.8	25,261	-1,207	0.02%	-1,428	-355	1,681	483	1,198
삼성전자	73,100	2.24	1,082.7	70.8	1,132,606	-47,820	-0.01%	-7,703	-3,701	11,022	-37,165	34,051
SK 이노베이션	216,500	1.17	215.4	67.9	34,110	3,614	0.08%	-3,083	5,793	-3,109	-1,080	-1,726
LG 화학	639,000	5.10	212.0	65.0	17,645	-828	-0.17%	-1,340	935	205	-880	69
SK	218,000	3.81	36.1	63.0	6,434	2,740	0.10%	-418	-282	700	-1,302	-1,243
SK 하이닉스	120,000	5.26	345.7	61.5	180,230	4,754	0.05%	-2,846	-3,995	7,027	-1,310	1,385

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터