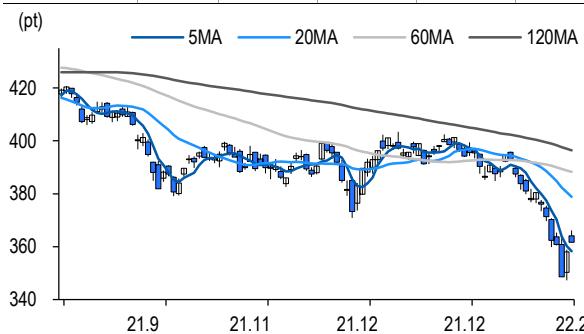


선물옵션시장 지표

2022.2.4

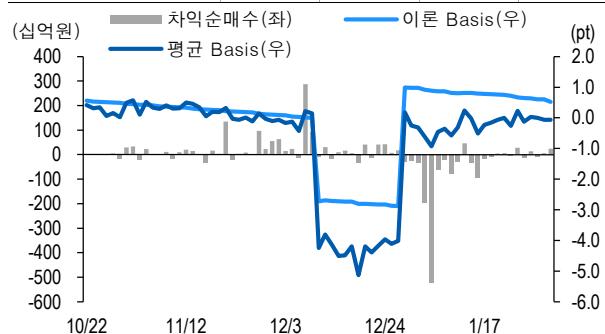
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	361.60	1.01	3.62	7,742.4	-
선물 3월물	361.50	1.37	4.90	27,333.7	267,932
선물 6월물	361.60	1.27	4.55	30.2	12,573
2월물(mini)	361.68	1.34	4.80	1,914.4	56,732
3월물(mini)	361.50	1.37	4.62	15.5	4,475



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.52	-0.06	-0.10	-0.16%
베이시스(mini)	0.10	0.00	0.08	-0.03%
제1스프레드(SP)	0.74	0.21	0.10	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.10	0.02	0.02	-0.02%



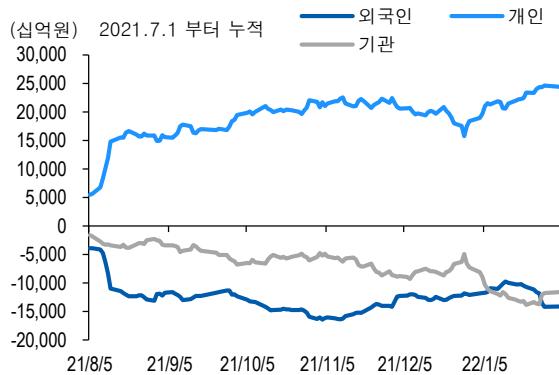
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	84.4	-42.0	42.5	0.2	24.2	-209.3	52.0	0.6	-31.3	-19.0
개인	-135.0	-80.3	-215.3	0.0	2.3	-15.9	14.5	0.6	29.2	-13.3
기관	50.2	124.2	174.4	24.0	58.8	291.3	-65.7	-2.3	3.0	31.3
금융투자	-108.5	139.5	30.9	31.2	4.7	-274.9	-66.6	-2.4	3.8	43.4
투신	40.2	9.7	49.9	0.0	19.9	603.9	0.7	-0.1	0.0	-5.7
은행+보험+기타금융	31.6	-2.4	29.2	0.0	4.9	-45.2	0.2	0.2	-0.8	0.9
연기금+국가지자체	133.6	-14.2	119.4	-7.2	31.9	7.5	0.0	0.0	0.0	-7.3
기타법인	0.4	-2.0	-1.6	0.0	0.6	-66.1	-0.8	1.1	-0.9	1.0

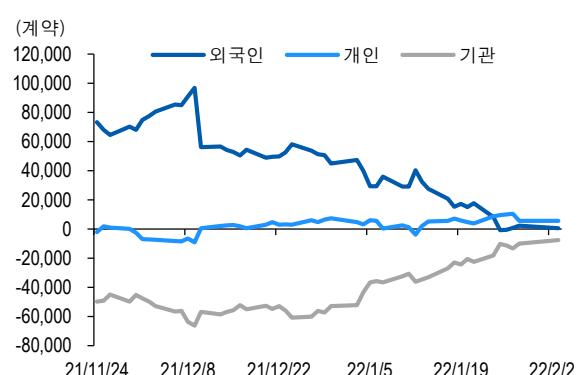
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,075,250	309.4	1,047,753	19.2%	지수옵션 전체	2,486,571	637.1	2,395,265
Put	1,411,321	327.6	1,347,512	22.3%	PCR(금액기준)	1.06	VKOSPI	22.92%(-1.05%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	365.0(K+3)	2.68	0.18	44,384	13,588	-1,638	19.2	360.0(K+1)
	362.5(K+2)	3.83	0.48	13,895	8,939	-645	19.7	357.5(K+0)
	360.0(K+1)	5.22	0.80	9,852	10,968	-835	20.2	355.0(K-1)
	357.5(K+0)	6.85	1.13	3,501	4,612	-364	20.8	352.5(K-2)
	355.0(K-1)	8.66	1.57	2,744	3,633	-180	21.4	350.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	360.0(K+1)	3.60	-3.90	61,112	16,727	1,181	20.7	360.0(K+1)
	357.5(K+0)	2.73	-3.54	72,870	15,823	2,587	21.3	357.5(K+0)
	355.0(K-1)	2.04	-3.13	86,503	18,692	2,808	22.0	355.0(K-1)
	352.5(K-2)	1.52	-2.76	85,649	17,962	3,825	22.7	352.5(K-2)
	350.0(K-3)	1.10	-2.40	141,558	23,588	2,154	23.2	350.0(K-3)

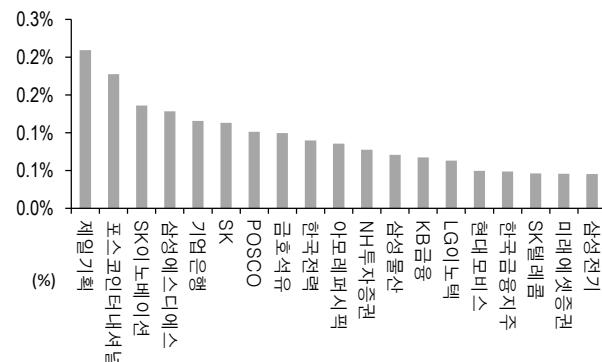
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,761,302	3,235.7	5,364,978	150,182	-5,349	2,100	2,458	-19.0	-13.3	31.3
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
LG 화학	678,000	6.10	196.6	81.7	19,495	1,850	-0.45%	-770	-1,718	2,511
호텔신라	71,800	-0.14	20.8	76.7	38,287	7,770	-0.22%	1,254	149	-1,403
GS 건설	39,300	0.51	13.4	74.1	38,675	-1,806	0.00%	-4,017	1,620	2,397
LG 이노텍	352,500	-0.56	130.3	72.5	17,336	2,010	0.06%	-622	451	145
삼성전자	73,500	0.55	824.4	63.9	1,140,594	7,988	0.01%	13,600	-1,110	-13,294
POSCO	268,500	0.94	60.4	62.2	25,399	138	0.10%	605	-521	-118
넥센타이어	6,440	3.37	0.6	61.3	5,374	-57	-0.03%	704	-116	-588
하나금융지주	44,900	-0.44	31.4	60.8	96,260	1,377	0.04%	-422	4,203	-3,849
현대차	191,000	0.53	96.4	59.5	38,119	837	-0.05%	191	-8	-277
SK	222,000	1.83	23.3	59.4	8,060	1,626	0.11%	809	32	-841

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터