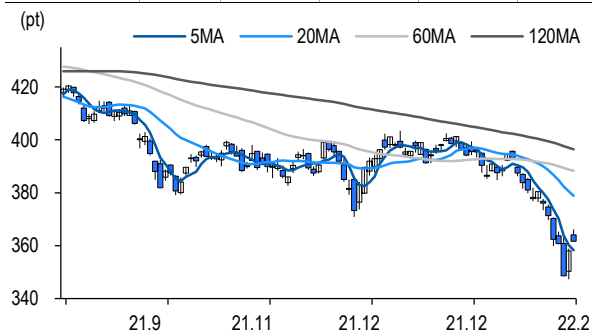


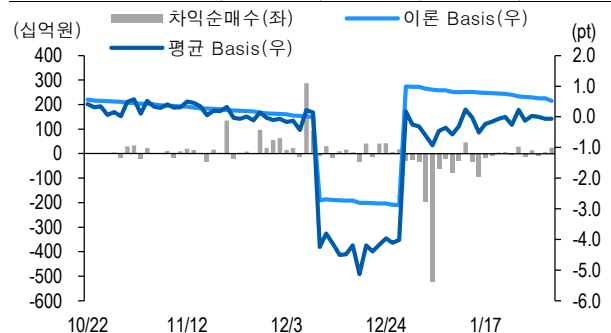
선물옵션시장 지표

2022.2.4

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(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



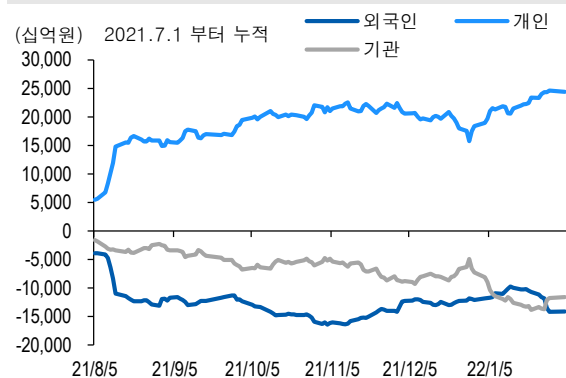
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.52	-0.06	-0.10	-0.16%
베이스(mini)	0.10	0.00	0.08	-0.03%
제1스프레드(SP)	0.74	0.21	0.10	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.10	0.02	0.02	-0.02%



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

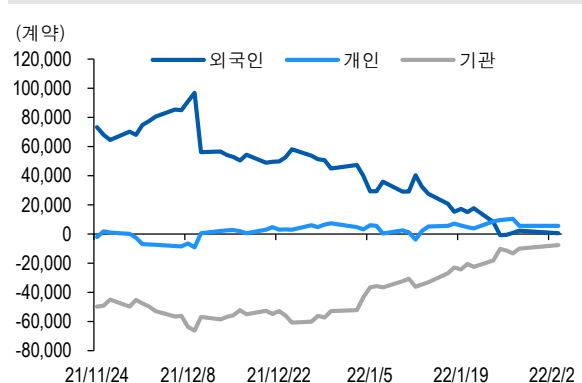
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향													(계약, 십억원)			
	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)		

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		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	Put	360.0(K+1)	3.60	−3.90	61,112	16,727	1,181	20.7
	362.5(K+2)	3.83	0.48	13,895	8,939	−645	19.7		357.5(K+0)	2.73	−3.54	72,870	15,823	2,587	21.3
	360.0(K+1)	5.22	0.80	9,852	10,968	−835	20.2		355.0(K−1)	2.04	−3.13	86,503	18,692	2,808	22.0
	357.5(K+0)	6.85	1.13	3,501	4,612	−364	20.8		352.5(K−2)	1.52	−2.76	85,649	17,962	3,825	22.7
	355.0(K−1)	8.66	1.57	2,744	3,633	−180	21.4		350.0(K−3)	1.10	−2.40	141,558	23,588	2,154	23.2

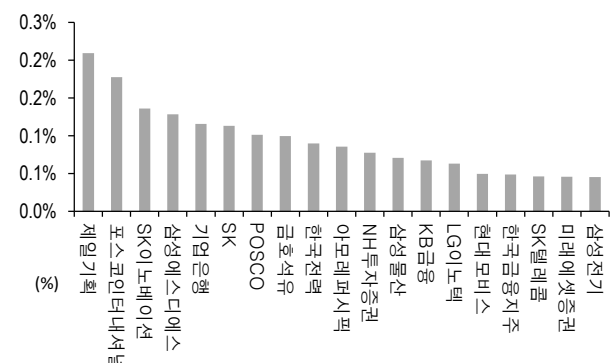
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	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 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금융 순매수
LG 화학	678,000	6.10	196.6	81.7	19,495	1,850	-0.45%	-770	-1,718	2,511	3,070	1,158
호텔신라	71,800	-0.14	20.8	76.7	38,287	7,770	-0.22%	1,254	149	-1,403	7,370	474
GS 건설	39,300	0.51	13.4	74.1	38,675	-1,806	0.00%	-4,017	1,620	2,397	594	1,803
LG 이노텍	352,500	-0.56	130.3	72.5	17,336	2,010	0.06%	-622	451	145	7	-1,732
삼성전자	73,500	0.55	824.4	63.9	1,140,594	7,988	0.01%	13,600	-1,110	-13,294	10,281	-25,759
POSCO	268,500	0.94	60.4	62.2	25,399	138	0.10%	605	-521	-118	496	-614
넥센타이어	6,440	3.37	0.6	61.3	5,374	-57	-0.03%	704	-116	-588	-585	-3
하나금융지주	44,900	-0.44	31.4	60.8	96,260	1,377	0.04%	-422	4,203	-3,849	-287	-3,003
현대차	191,000	0.53	96.4	59.5	38,119	837	-0.05%	191	-8	-277	-2,357	1,615
SK	222,000	1.83	23.3	59.4	8,060	1,626	0.11%	809	32	-841	-327	-1,623

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터