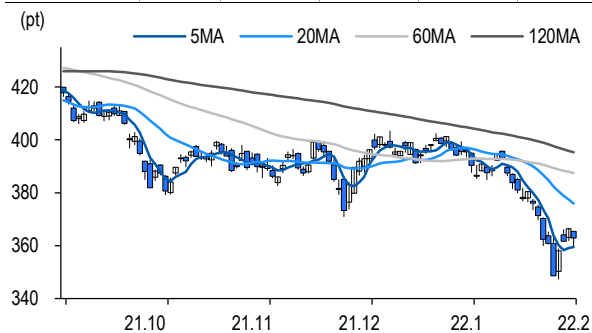


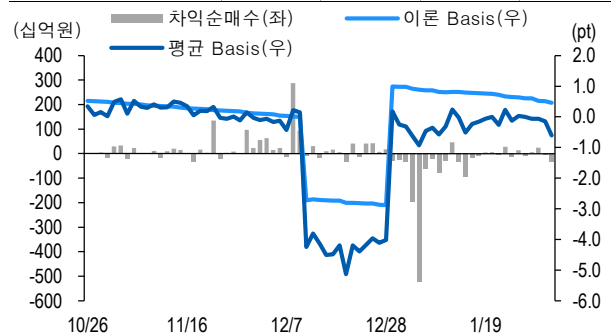
선물옵션시장 지표

2022.2.8

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	362.92	-0.93	-3.42	7,093.5	-
선물 3월물	363.25	-0.86	-3.15	27,626.7	275,053
선물 6월물	363.05	-0.91	-3.35	29.9	12,665
2월물(mini)	363.52	-0.81	-2.98	2,040.0	67,612
3월물(mini)	363.06	-0.91	-3.14	24.9	5,584



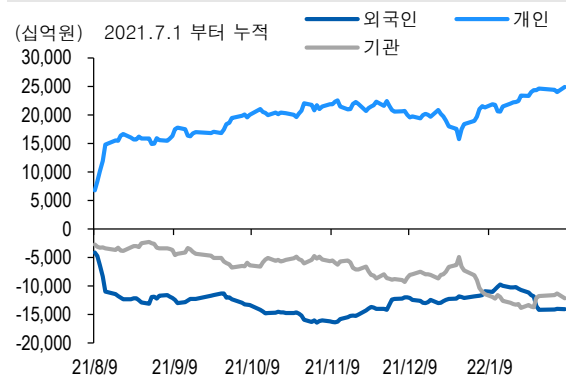
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.46	-0.61	0.33	-0.30%
베이스(mini)	0.04	-0.32	0.60	-0.10%
제1스프레드(SP)	0.74	0.23	0.25	-0.14%
합성선물 베이스(ATM)	0.04	0.59	0.59	0.15%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-5.3	-18.6	-24.0	-8.8	-105.3	-372.6	54.9	4.1	1.5	-20.4
개인	810.2	62.8	873.0	0.0	11.5	39.9	-20.6	-3.8	0.2	-21.0
기관	-833.7	-47.8	-881.5	-24.4	-9.1	440.0	-37.2	0.2	-1.1	37.4
금융투자	-751.7	-90.3	-841.9	-15.2	0.2	669.8	-35.4	1.4	-1.0	55.2
투신	23.5	0.8	24.3	0.0	10.0	-288.2	0.9	-0.4	-0.1	-54.8
은행+보험+기타금융	17.8	27.3	45.1	0.0	9.6	-8.4	-2.7	-0.8	0.0	0.7
연기금+국가지자체	-78.0	7.6	-70.4	-9.2	-28.6	66.8	0.0	0.0	0.0	36.3
기타법인	28.9	3.6	32.4	0.0	2.1	-107.2	2.9	-0.5	-0.7	3.9

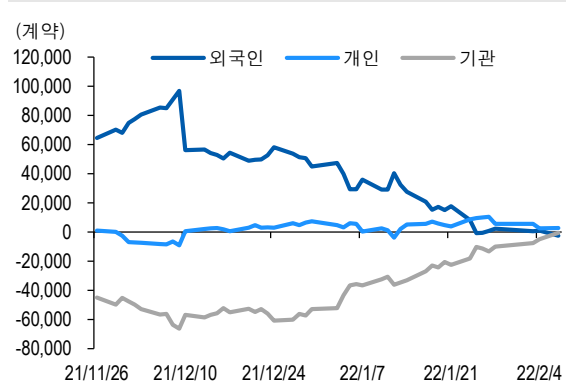
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,893,338	335.9	1,138,253	20.7%	지수옵션 전체	3,705,605	799.9	2,634,546
Put	1,812,267	464.0	1,496,293	20.7%	PCR(금액기준)	1.38	VKOSPI	21.59%(+0.57%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	375.0(K+3)	0.22	-0.38	262,575	37,381	-3,336	20.4	Put	370.0(K+1)	7.27	1.83	1,671	18,662	1	14.2
	372.5(K+2)	0.41	-0.69	273,408	28,005	8,051	20.1		367.5(K+0)	5.43	1.32	5,452	8,858	843	16.8
	370.0(K+1)	0.80	-1.10	378,560	32,073	6,087	20.5		365.0(K-1)	3.92	0.90	14,548	14,368	326	18.4
	367.5(K+0)	1.44	-1.56	243,174	20,863	6,464	21.0		362.5(K-2)	2.73	0.53	41,756	13,862	945	19.6
	365.0(K-1)	2.40	-1.92	158,224	15,646	2,303	21.8		360.0(K-3)	1.87	0.28	108,863	21,444	1,434	20.8

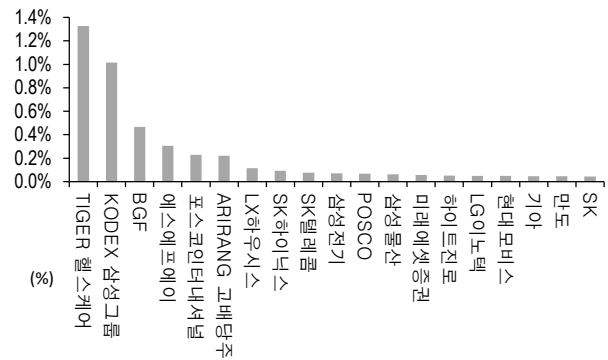
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	4,663,099	3,747.7	5,687,812	200,025	-35,073	-15,438	46,458	-20.4	-21.0	37.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	123,500	-1.20	514.5	88.7	196,179	6,701	0.09%	-222	-6,929	7,021	3,818	-1,920
GS 건설	39,450	-3.07	18.0	83.9	25,712	-11,532	0.02%	6,812	-11,509	4,697	1,537	3,160
LG 화학	642,000	-5.31	160.9	78.4	18,584	-525	-0.28%	1,396	37	-1,485	-609	243
하나금융지주	46,050	0.33	45.1	74.4	85,358	-8,229	0.01%	-4,817	-525	5,159	3,006	2,153
삼성전자	73,300	-0.95	740.6	72.3	880,187	-255,834	-0.10%	-4,005	-1,342	1,820	13,131	11,438
SK 이노베이션	226,500	-0.88	79.7	69.7	30,757	-3,890	0.03%	699	-3,860	2,961	1,096	1,848
POSCO	268,000	-0.19	51.5	68.8	23,877	-1,035	0.07%	-876	-488	1,335	-308	1,598
현대제철	39,100	-0.13	11.9	65.5	15,615	-1,933	0.00%	396	698	-1,094	-2,303	1,209
LG 이노텍	335,000	-3.87	102.1	61.0	15,865	-1,615	0.05%	498	264	-792	638	-1
현대차	186,000	-2.11	93.1	60.7	39,134	949	-0.24%	696	-684	-13	7,620	1,051

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터