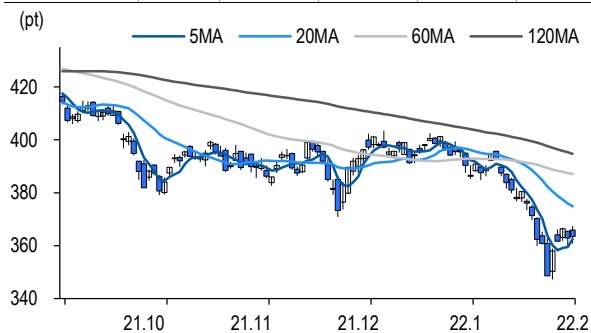


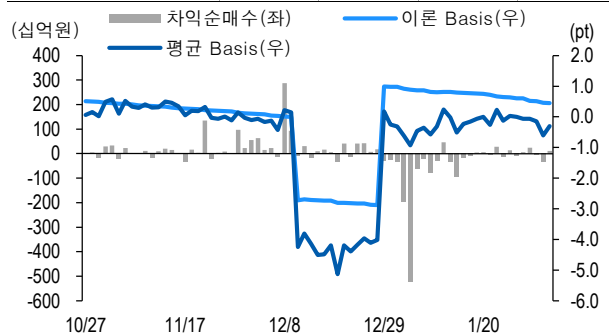
선물옵션시장 지표

2022.2.9

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	363.48	0.15	0.56	7,482.9	-
선물 3월물	363.20	-0.01	-0.05	24,839.4	276,538
선물 6월물	363.25	0.06	0.20	39.8	12,730
2월물(mini)	363.34	-0.05	-0.18	1,877.5	70,092
3월물(mini)	363.42	0.04	0.36	27.9	9,484



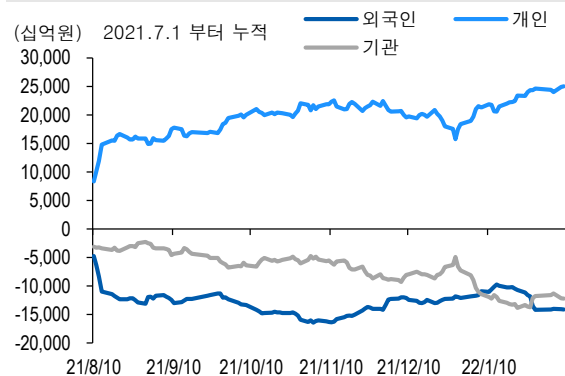
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.45	-0.30	-0.28	-0.21%
베이스(mini)	0.03	-0.12	-0.14	-0.04%
제1스프레드(SP)	0.75	0.21	0.25	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.03	-0.15	-0.15	-0.05%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-96.3	-6.8	-103.1	-0.6	-26.7	481.8	-38.1	-0.6	2.6	27.2
개인	45.8	93.6	139.4	0.0	1.5	-54.0	3.1	1.8	-1.3	-17.1
기관	39.3	-86.4	-47.1	12.0	-8.1	-507.7	34.8	0.2	-1.0	-5.9
금융투자	64.8	-78.3	-13.6	1.0	0.8	-566.3	34.8	-0.5	-1.0	-19.3
투신	-15.6	22.7	7.1	0.0	-2.7	102.8	-2.6	-0.2	0.0	14.4
은행+보험+기타금융	-12.0	-24.3	-36.3	0.0	6.5	-23.9	2.6	0.9	-0.1	-0.1
연기금+국가지자체	24.1	-8.8	15.3	11.0	-9.5	-20.3	0.0	0.0	0.0	-0.9
기타법인	11.2	-0.4	10.8	0.0	0.7	79.8	0.2	-1.5	-0.2	-4.2

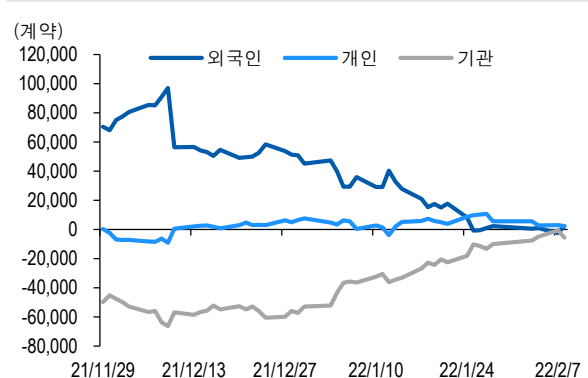
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,959,676	355.1	1,191,118	17.4%	지수옵션 전체	4,326,430	816.3	2,691,794
Put	2,366,754	461.3	1,500,676	21.3%	PCR(금액기준)	1.30	VKOSPI	21.06%(-0.53%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	370.0(K+3)	0.38	-0.42	421,163	35,758	3,685	17.4	Put	365.0(K+1)	3.39	-0.53	119,421	17,568	3,200	19.6
	367.5(K+2)	0.84	-0.60	259,750	23,261	2,398	17.4		362.5(K+0)	2.14	-0.59	206,308	16,719	2,857	20.0
	365.0(K+1)	1.71	-0.69	136,728	16,263	617	18.0		360.0(K-1)	1.31	-0.56	329,012	24,294	2,850	20.8
	362.5(K+0)	2.97	-0.72	40,727	12,497	2,198	18.5		357.5(K-2)	0.76	-0.44	303,802	22,086	1,812	21.5
	360.0(K-1)	4.63	-0.68	14,066	9,456	-2,149	19.0		355.0(K-3)	0.42	-0.36	338,192	27,128	1,075	22.1

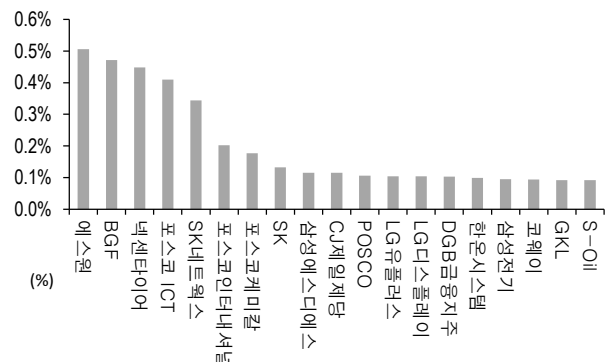
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배출 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,990,294	3,471.5	5,537,004	-150,808	30,867	-24,026	-2,404	27.2	-17.1	-5.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배출 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	125,000	1.21	410.4	81.6	180,348	-15,831	0.06%	-1,564	-8,845	10,507	-1,272	3,340
삼성전자	73,500	0.27	665.8	77.2	751,423	-128,764	-0.07%	7,073	-8,890	6,632	5,281	749
LG 이노텍	326,500	-2.54	130.6	68.2	14,041	-1,824	0.03%	1,573	64	-1,645	817	-248
하나금융지주	46,050	0.00	25.3	59.7	77,599	-7,759	-0.01%	1,841	-3,608	1,519	1,418	28
LG 화학	617,000	-3.89	245.2	58.9	17,402	-1,182	-0.07%	1,163	500	-1,633	-879	-911
삼성전기	167,500	-0.30	49.4	58.2	27,303	-6,435	0.10%	401	4,095	-4,498	-4,279	-221
GS 건설	39,300	-0.38	10.7	57.1	19,694	-6,018	0.04%	502	-155	-347	-592	245
POSCO	267,500	-0.19	53.9	56.9	22,921	-956	0.11%	-737	93	591	292	299
두산중공업	17,400	0.29	64.2	54.4	622,149	-219,856	0.03%	38,699	-4,060	-34,640	-29,312	-1,390
LG 전자	123,500	-1.20	42.2	53.3	27,401	-903	-0.07%	565	-184	-340	181	-521

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터