

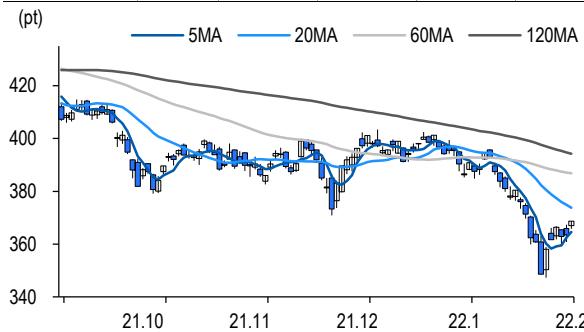


선물옵션시장 지표

2022.2.10

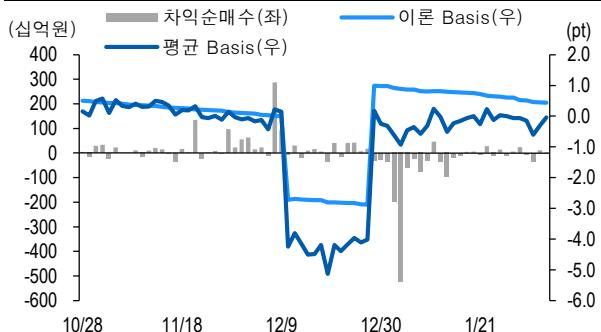
Market Data (십억원, 계약)

| | 종가(pt) | 등락률(%) | 등락폭(pt) | 거래대금 | 미결제 |
|-----------|--------|--------|---------|----------|---------|
| KOSPI200 | 368.65 | 1.42 | 5.17 | 6,408.3 | - |
| 선물 3월물 | 368.90 | 1.57 | 5.70 | 20,179.5 | 272,403 |
| 선물 6월물 | 369.05 | 1.60 | 5.80 | 25.4 | 12,766 |
| 2월물(mini) | 369.18 | 1.61 | 5.84 | 1,384.7 | 76,954 |
| 3월물(mini) | 368.84 | 1.55 | 5.42 | 44.6 | 12,079 |



차익거래 관련 Market data (pt)

| | 이론값 | 평균값 | 현재가 | 괴리율(%) |
|----------------|------|-------|------|--------|
| K200 베이시스 | 0.44 | -0.04 | 0.25 | -0.13% |
| 베이시스(mini) | 0.02 | 0.02 | 0.53 | 0.00% |
| 제1스프레드(SP) | 0.77 | 0.21 | 0.25 | -0.15% |
| 합성선물 베이시스(ATM) | 0.02 | 0.43 | 0.43 | 0.11% |

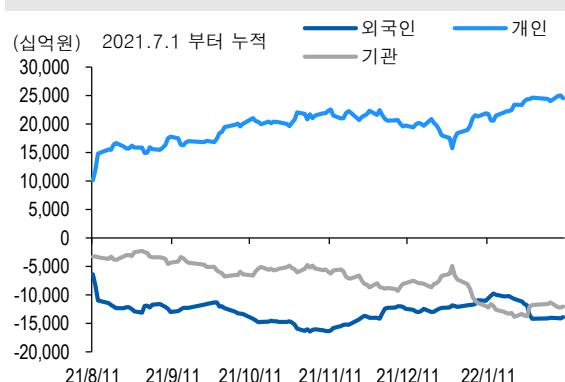


투자주체별 매매 동향 (십억원)

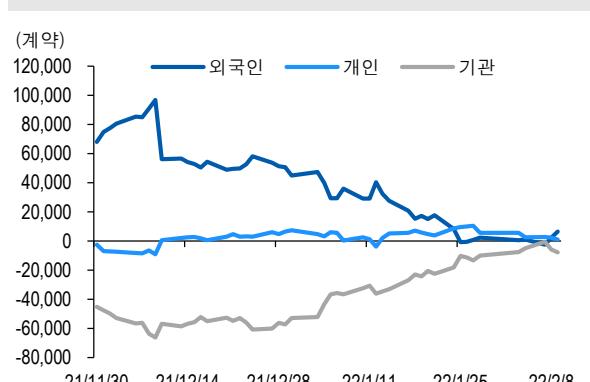
| | KOSPI | ETF 전체 | KOSPI+ETF | 차익 PR | 비차익 PR | K200F | K200F(mini) | 콜옵션 | 풋옵션 | 주식선물전체 |
|------------|--------|--------|-----------|-------|--------|--------|-------------|------|------|--------|
| 외국인 | 238.7 | 27.3 | 266.1 | 0.7 | 203.5 | 357.1 | 29.5 | -5.1 | 1.7 | 0.6 |
| 개인 | -459.0 | -34.7 | -493.7 | 0.0 | 0.6 | -69.4 | -37.4 | 4.5 | -2.3 | -0.7 |
| 기관 | 196.7 | 5.8 | 202.5 | 2.4 | -52.3 | -205.8 | 10.7 | -0.6 | 1.4 | 1.3 |
| 금융투자 | 195.9 | 80.0 | 275.9 | 0.6 | 3.6 | -401.6 | 2.7 | -0.7 | 1.9 | -37.2 |
| 투신 | -14.9 | -1.7 | -16.6 | 0.0 | -21.9 | 162.1 | 8.3 | 0.0 | 0.0 | 35.5 |
| 은행+보험+기타금융 | 1.0 | -69.3 | -68.3 | 0.0 | 4.9 | 46.5 | -0.3 | 0.0 | -0.4 | -3.8 |
| 연기금+국가지자체 | 14.5 | -8.9 | 5.6 | 1.8 | 0.2 | -12.8 | 0.0 | 0.1 | 0.0 | 6.8 |
| 기타법인 | 23.5 | 1.7 | 25.1 | 0.0 | 0.5 | -82.0 | -2.8 | 1.3 | -0.9 | -1.3 |

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이

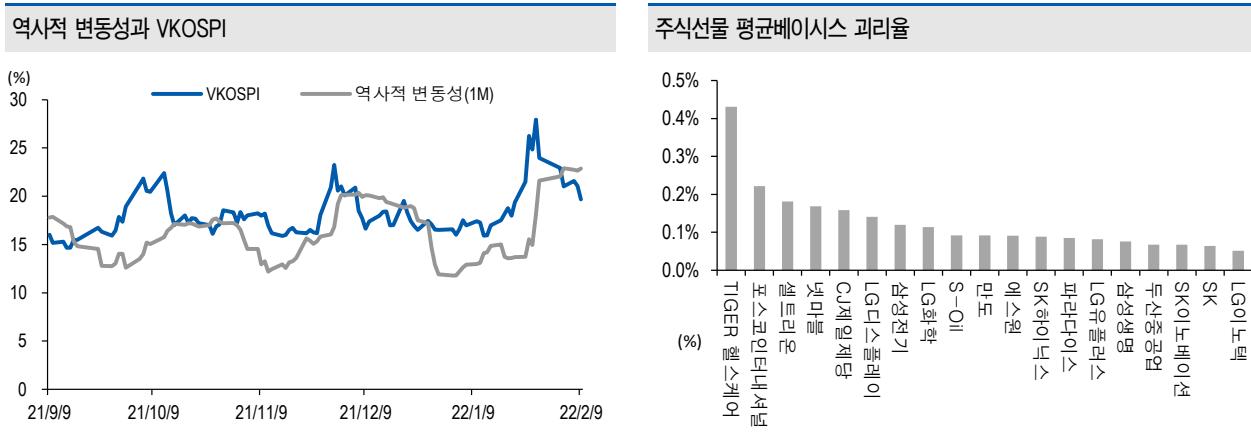


자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

| 지수옵션 시장동향 | | | | | | | | (계약, 십억원) | | | |
|-----------|------------|-------|-----------|---------|-----------|--------|-----------|------------|-----------------|--------|---------|
| | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | 대표변동성 | | 거래량 | 거래대금 | 미결제약정 | | | |
| Call | 1,623,709 | 342.4 | 1,197,928 | 16.5% | 지수옵션 전체 | | 3,409,750 | 594.9 | 2,784,870 | | |
| Put | 1,786,041 | 252.6 | 1,586,942 | 17.6% | PCR(금액기준) | | 0.74 | VKOSPI | 19.68%(-1.38%p) | | |
| Call | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 |
| | 370.0(K+3) | 1.14 | 0.76 | 421,020 | 32,753 | -3,005 | 15.8 | 365.0(K+1) | 0.42 | -2.97 | 256,891 |
| | 367.5(K+2) | 2.55 | 1.71 | 245,113 | 21,660 | -1,601 | 17.5 | 362.5(K+0) | 0.16 | -1.98 | 330,544 |
| | 365.0(K+1) | 4.52 | 2.81 | 75,994 | 15,864 | -399 | 20.4 | 360.0(K-1) | 0.08 | -1.23 | 348,137 |
| | 362.5(K+0) | 6.74 | 3.77 | 15,991 | 11,741 | -756 | 23.5 | 357.5(K-2) | 0.04 | -0.72 | 225,222 |
| | 360.0(K-1) | 9.11 | 4.48 | 4,447 | 8,540 | -916 | 27.3 | 355.0(K-3) | 0.02 | -0.40 | 106,958 |
| Put | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 | 미결제약정 | 미결제증감 | 내재변동성 | 행사가 | 종가 | 등락(pt) | 거래량 |
| | 365.0(K+1) | 0.42 | -2.97 | 256,891 | 23,640 | 6,072 | 15.2 | 362.5(K+0) | 0.16 | -1.98 | 330,544 |
| | 360.0(K-1) | 0.08 | -1.23 | 348,137 | 31,026 | 6,732 | 18.4 | 357.5(K-2) | 0.04 | -0.72 | 225,222 |
| | 355.0(K-3) | 0.02 | -0.40 | 106,958 | 28,104 | 976 | 22.0 | 355.0(K-3) | 0.02 | -0.40 | 106,958 |
| | 355.0(K-3) | 0.02 | -0.40 | 106,958 | 28,104 | 976 | 22.0 | 355.0(K-3) | 0.02 | -0.40 | 106,958 |
| | 355.0(K-3) | 0.02 | -0.40 | 106,958 | 28,104 | 976 | 22.0 | 355.0(K-3) | 0.02 | -0.40 | 106,958 |

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

자료: KRX, 유인타증권 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 | 3,503,252 | 2,920.8 | 5,491,354 | -45,650 | 59,057 | 12,464 | -67,922 | 0.6 | -0.7 | 1.3 | |
| 종목명 | 선물현재가 (원) | 등락률 (%) | 선물거래대금 (십억원) | 선현배율 (%) | 미결제수량 (계약) | 미결제증감 (계약) | 평균괴리율 (%) | 외국인 순매수 | 개인 순매수 | 기관 순매수 | 금융투자 순매수 |
| SK 하이닉스 | 126,500 | 1.20 | 362.0 | 66.1 | 178,832 | -1,516 | 0.09% | -2,482 | -6,593 | 9,144 | -1,236 |
| 삼성전자 | 74,600 | 1.50 | 442.3 | 61.8 | 560,790 | -190,633 | 0.01% | -10,853 | 39,553 | -28,070 | -24,150 |
| 삼성전기 | 171,500 | 2.39 | 60.2 | 58.3 | 21,311 | -5,992 | 0.12% | 3,127 | -988 | -2,147 | -935 |
| LG 이노텍 | 337,500 | 3.37 | 84.7 | 55.1 | 12,139 | -1,902 | 0.05% | -812 | 175 | 587 | -339 |
| GS 건설 | 40,450 | 2.93 | 7.3 | 53.9 | 13,771 | -5,923 | 0.02% | 4,453 | -1,823 | -2,980 | -2,460 |
| 호텔신라 | 79,000 | 1.80 | 17.2 | 52.9 | 35,896 | -5,744 | -0.03% | -150 | 616 | -466 | -5,630 |
| POSCO | 282,500 | 5.61 | 77.1 | 52.0 | 16,882 | -6,039 | 0.04% | -533 | -654 | 1,239 | -53 |
| 셀트리온헬스케어 | 64,500 | 0.62 | 12.0 | 49.7 | 37,516 | -4,826 | -0.08% | -179 | -1,981 | 2,160 | -2,416 |
| 기아 | 80,300 | 1.77 | 50.5 | 49.5 | 19,210 | -5,378 | -0.03% | 475 | -2,738 | 2,263 | 936 |
| LG 화학 | 620,000 | 0.49 | 115.6 | 48.4 | 14,790 | -2,612 | 0.11% | -753 | 1,163 | -436 | -1,325 |

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터