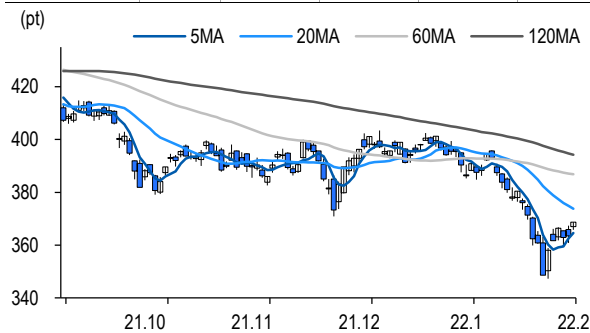


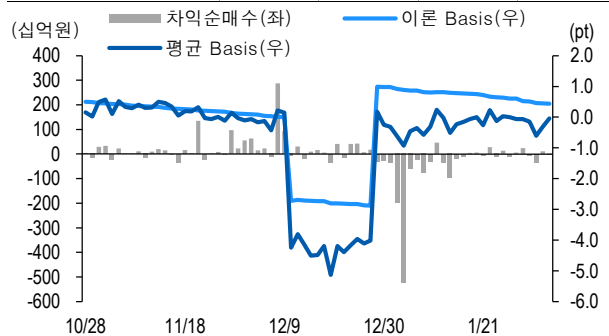
선물옵션시장 지표

2022.2.10

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(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



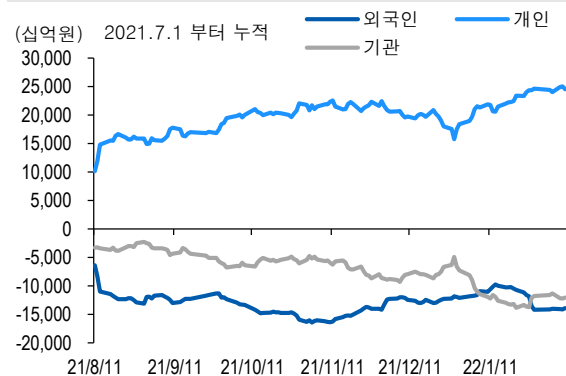
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.44	-0.04	0.25	-0.13%
베이스(mini)	0.02	0.02	0.53	0.00%
제1스프레드(SP)	0.77	0.21	0.25	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.02	0.43	0.43	0.11%



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

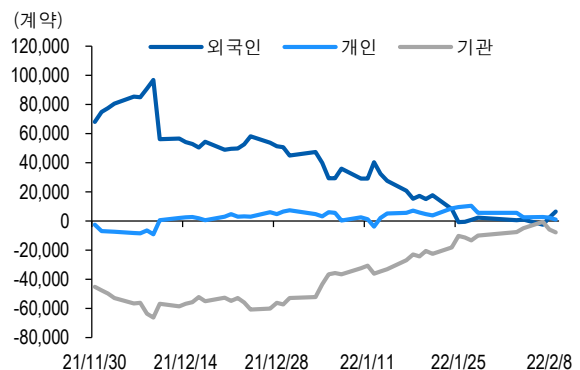
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



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)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	370.0(K+3)	1.14	0.76	421,020	32,753	-3,005	15.8	Put	365.0(K+1)	0.42	-2.97	256,891	23,640	6,072	15.2
	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	34,959	18,240	16.3
	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	31,026	6,732	18.4
	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	29,631	7,545	20.3
	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	28,104	976	22.0

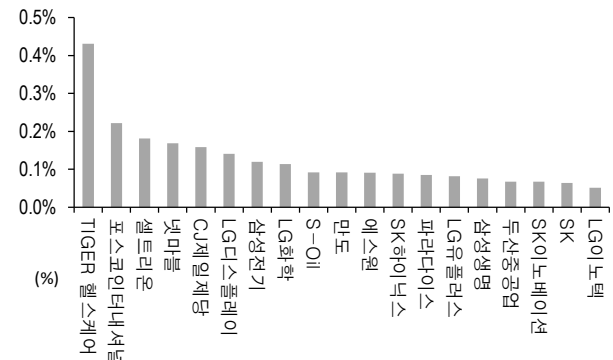
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,503,252	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	연기금등 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	-1,763
삼성전자	74,600	1.50	442.3	61.8	560,790	-190,633	0.01%	-10,853	39,553	-28,070	-24,150	-2,450
삼성전기	171,500	2.39	60.2	58.3	21,311	-5,992	0.12%	3,127	-988	-2,147	-935	-1,214
LG 이노텍	337,500	3.37	84.7	55.1	12,139	-1,902	0.05%	-812	175	587	-339	942
GS 건설	40,450	2.93	7.3	53.9	13,771	-5,923	0.02%	4,453	-1,823	-2,980	-2,460	-520
호텔신라	79,000	1.80	17.2	52.9	35,896	-5,744	-0.03%	-150	616	-466	-5,630	436
POSCO	282,500	5.61	77.1	52.0	16,882	-6,039	0.04%	-533	-654	1,239	-53	1,292
셀트리온헬스케어	64,500	0.62	12.0	49.7	37,516	-4,826	-0.08%	-179	-1,981	2,160	-2,416	0
기아	80,300	1.77	50.5	49.5	19,210	-5,378	-0.03%	475	-2,738	2,263	936	336
LG 화학	620,000	0.49	115.6	48.4	14,790	-2,612	0.11%	-753	1,163	-436	-1,325	-417

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터