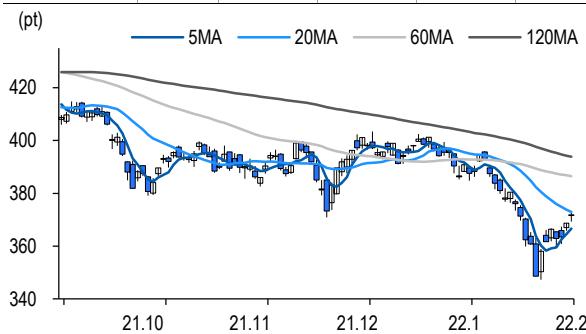


선물옵션시장 지표

2022.2.11

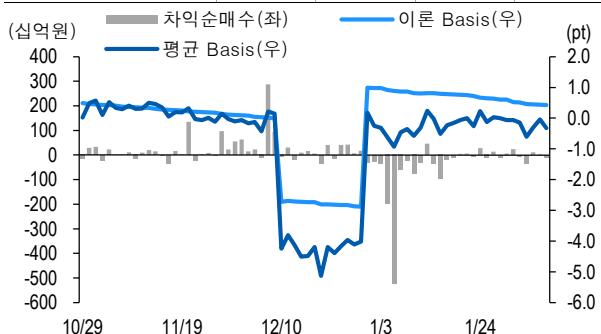
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	371.57	0.79	2.92	8,891.2	-
선물 3월물	371.75	0.77	2.85	27,651.5	263,861
선물 6월물	371.75	0.73	2.70	41.4	12,917
2월물(mini)	372.24	0.83	3.06	855.3	0
3월물(mini)	371.70	0.76	2.86	1,111.0	37,484



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.43	-0.32	0.18	-0.20%
베이시스(mini)	0.00	0.00	0.67	0.00%
제1스프레드(SP)	0.78	0.23	0.25	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	0.98	0.98	0.26%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

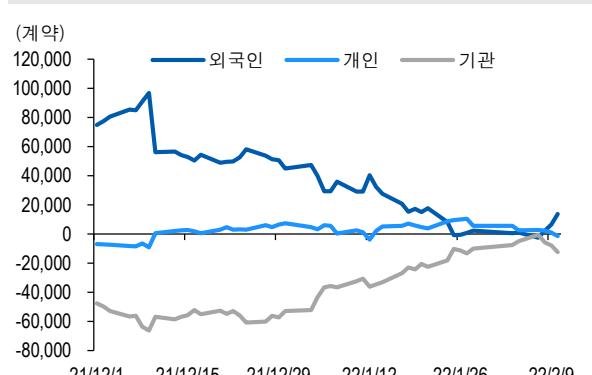
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	834.8	-16.5	818.3	-1.1	779.7	619.0	53.6	-1.5	0.1	-49.2
개인	-308.1	103.8	-204.3	0.0	3.2	-205.6	-33.4	6.4	-4.3	40.3
기관	-541.9	-90.4	-632.2	-9.8	-132.9	-412.4	-17.2	-6.0	4.4	7.9
금융투자	-432.2	-93.0	-525.2	-13.6	-117.5	-266.3	-33.8	-3.0	4.4	-48.4
투신	-83.0	-4.7	-87.7	0.0	-22.8	-126.2	4.6	-2.2	0.0	108.6
은행+보험+기타금융	1.0	4.8	5.8	0.0	2.5	-34.0	12.0	-0.6	-0.1	1.8
연기금+국가지자체	-6.8	-0.1	-6.9	3.8	4.9	14.0	0.0	-0.2	0.1	-54.1
기타법인	15.1	3.1	18.2	0.0	1.6	-1.1	-2.9	1.1	-0.2	0.9

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
Call	2,544,028	399.9	504,288	10.7%	지수옵션 전체	5,013,528	719.5
Put	2,469,500	319.6	822,925	8.1%	PCR(금액기준)	0.80	VKOSPI 19.21%(-0.47%p)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	375.0(K+3)	0.01	-0.10	776,636	0	-52,538	8.3
	372.5(K+2)	0.22	-0.22	941,169	0	-31,053	7.2
	370.0(K+1)	2.31	1.17	416,317	0	-32,753	17.8
	367.5(K+0)	5.06	2.51	76,315	0	-21,660	32.5
	365.0(K-1)	7.36	2.84	6,954	0	-15,864	38.7
Put	370.0(K+1)	0.01	-2.06	814,566	0	-18,316	4.4
	367.5(K+0)	0.01	-0.99	741,622	0	-16,853	9.7
	365.0(K-1)	0.01	-0.41	165,490	0	-23,640	14.8
	362.5(K-2)	0.01	-0.15	103,802	0	-34,959	19.6
	360.0(K-3)	0.01	-0.07	55,108	0	-31,026	24.4

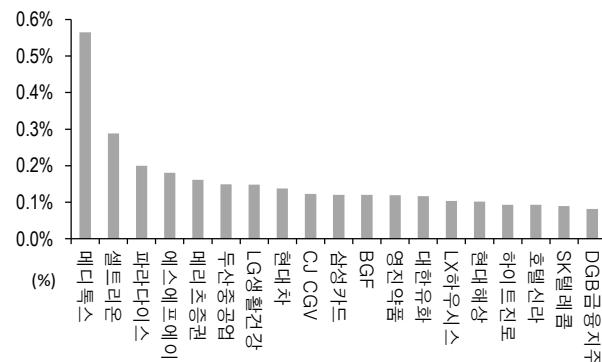
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	(계약, 십억원)
주식선물 전체	4,967,755	4,404.9	4,051,324	-1,440,030	-86,224	69,370	15,971	-49.2	40.3	7.9	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수
셀트리온헬스케어	64,700	0.31	29.1	72.4	0	-37,516	0.01%	-734	1,586	-869	-12,176
호텔신라	80,300	1.65	45.3	67.2	0	-35,896	0.09%	-3,188	768	2,401	5,020
셀트리온	161,500	0.62	32.1	50.7	0	-18,711	0.29%	3,711	-1,829	-1,894	-6,664
SK 하이닉스	130,500	3.16	469.3	50.6	0	-178,832	-0.16%	8,644	14,962	-23,660	-45,311
S-Oil	88,500	0.34	10.4	46.2	0	-11,714	-0.01%	1,112	-250	-836	-67
LG 이노텍	326,500	-3.26	51.2	33.1	0	-12,139	-0.02%	106	290	-417	1,192
LG 전자	128,500	-0.39	53.0	31.7	0	-23,098	-0.09%	-138	-2,866	2,752	1,807
삼성전자	75,400	1.07	411.5	31.4	0	-560,790	-0.08%	-31,484	34,234	-2,463	-19,883
POSCO	281,500	-0.35	25.3	29.0	0	-16,882	0.01%	-636	544	86	955
LG 화학	665,000	7.26	126.7	28.3	0	-14,790	0.07%	-783	-776	1,624	-269

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터