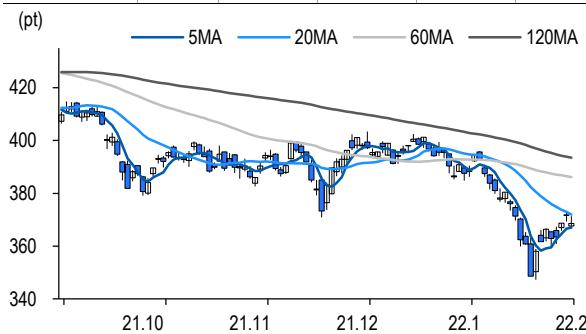


선물옵션시장 지표

2022.2.14

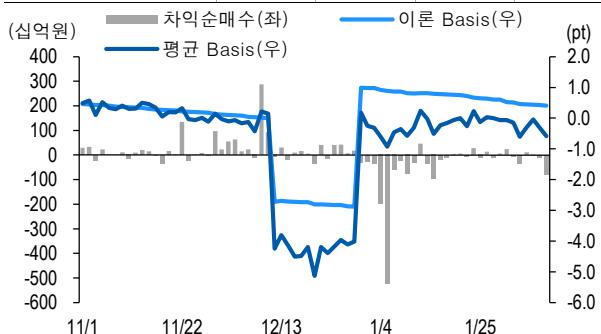
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	368.61	-0.80	-2.96	7,782.8	-
선물 3월물	368.00	-1.01	-3.75	26,570.9	264,857
선물 6월물	368.25	-0.94	-3.50	77.2	14,503
3월물(mini)	368.10	-0.98	-3.60	2,154.7	47,131
4월물(mini)	367.70	-0.89	-3.30	2.8	6,288



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.41	-0.58	-0.61	-0.27%
베이시스(mini)	0.41	-0.58	-0.51	-0.27%
제1스프레드(SP)	0.77	0.21	0.20	-0.15%
합성선물 베이시스(ATM)	0.41	-0.45	-0.45	-0.23%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	377.3	19.3	396.7	-11.2	155.8	263.5	-153.9	2.0	-3.0	-31.8
개인	71.6	107.9	179.6	0.0	6.6	79.9	11.9	-3.2	-0.8	1.4
기관	-463.3	-128.4	-591.7	-68.0	-70.9	-377.9	141.9	1.3	4.3	28.7
금융투자	-383.0	-117.3	-500.3	-19.4	-39.1	17.0	142.6	1.8	3.6	22.6
투신	-9.4	-12.7	-22.1	0.0	-29.0	-468.2	-0.8	-0.5	-0.3	-7.5
은행+보험+기타금융	2.9	-5.5	-2.6	0.0	6.1	17.4	0.0	0.0	1.0	4.3
연기금+국가지자체	-17.4	1.8	-15.6	-48.6	9.3	56.0	0.0	0.0	0.0	9.4
기타법인	14.4	1.1	15.5	0.0	1.3	34.4	0.2	-0.2	-0.5	1.7

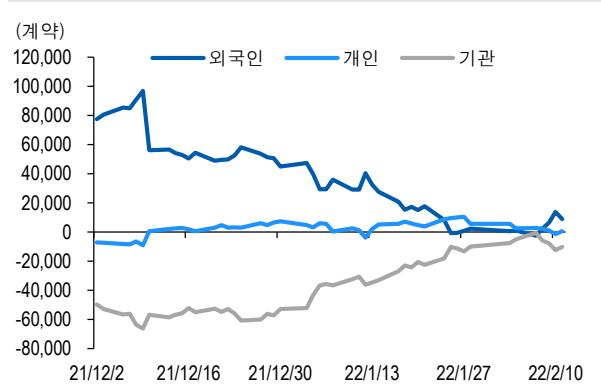
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

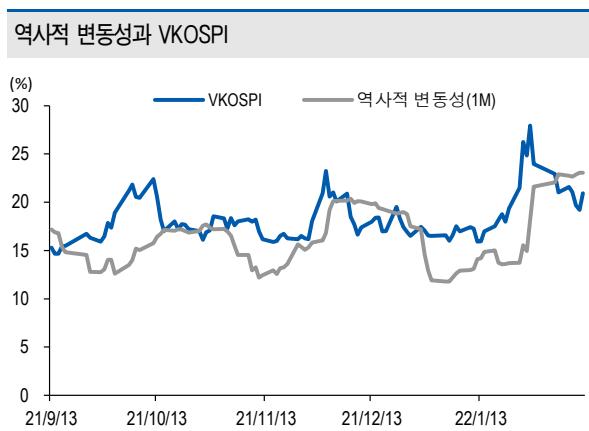
투자주체별 선물 누적 순매수 추이



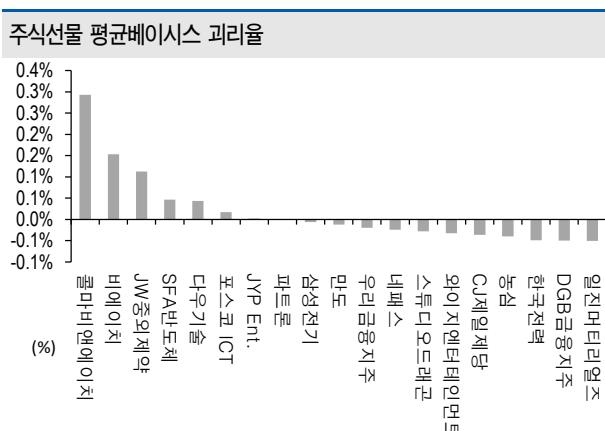
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향									(계약, 십억원)						
	거래량	거래대금	미결제약정		대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정						
Call	483,087	185.0	566,242		16.4%	지수옵션 전체	1,225,182	478.9	1,489,139						
Put	742,095	293.9	922,897		20.1%	PCR(금액기준)	1.59	VKOSPI	20.92%(+1.71%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	380.0(K+3)	2.64	-0.84	45,712	12,689	2,897	16.3	Put	375.0(K+1)	11.05	2.26	644	3,752	77	18.8
	377.5(K+2)	3.41	-1.00	23,164	6,085	2,031	16.6		372.5(K+0)	9.74	2.19	1,428	1,679	333	19.3
	375.0(K+1)	4.33	-1.18	12,295	7,971	1,195	16.8		370.0(K-1)	8.52	2.02	3,828	12,072	653	19.7
	372.5(K+0)	5.40	-1.37	6,709	3,759	774	17.1		367.5(K-2)	7.38	1.88	5,064	2,979	781	20.0
	370.0(K-1)	6.58	-1.59	4,672	10,351	921	17.3		365.0(K-3)	6.41	1.75	5,829	6,175	565	20.4

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	3,995,501	3,152.5	4,334,118	282,794	-65,235	54,084	10,202	-31.8	1.4	28.7
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리를 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
현대엘리베이	37,800	-1.05	4.9	148.3	3,653	804	-0.27%	-290	508	-320
넥센타이어	6,520	-1.36	0.8	124.2	4,019	277	-0.32%	-381	252	126
삼성전자	74,800	-0.93	747.1	82.9	1,073,977	64,619	-0.18%	-29,629	21,990	7,642
일진마티리얼즈	95,000	-1.04	21.4	79.5	139,203	1,739	-0.05%	1,416	16	-1,448
현대차	183,000	-1.35	121.5	66.7	44,930	3,245	-0.12%	2,165	793	-2,940
LG 이노텍	321,500	-1.68	98.2	63.7	10,408	-769	-0.11%	314	-1,166	919
LG 화학	635,000	-3.05	107.2	61.8	11,495	1,036	-0.10%	548	1,041	-1,587
대한유화	173,000	6.46	17.8	61.5	4,798	988	-0.41%	129	-117	216
NAVER	327,500	-1.65	88.9	60.3	29,573	2,341	-0.08%	376	-1,117	777
POSCO	290,000	2.65	93.5	60.1	20,262	623	-0.09%	-779	567	-115

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터