

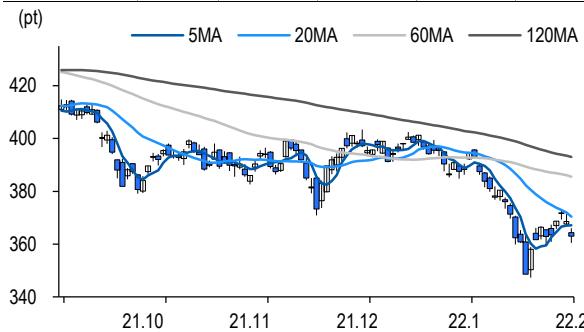


선물옵션시장 지표

2022.2.15

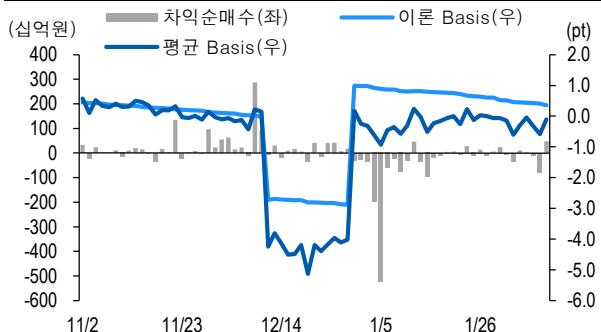
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	362.98	-1.53	-5.63	6,852.5	-
선물 3월물	363.65	-1.18	-4.35	27,216.6	264,105
선물 6월물	363.80	-1.21	-4.45	69.6	14,622
3월물(mini)	363.52	-1.22	-4.58	2,195.2	50,141
4월물(mini)	363.00	-1.28	-4.70	7.7	6,508



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.36	-0.11	0.67	-0.13%
베이시스(mini)	0.36	-0.11	0.54	-0.13%
제1스프레드(SP)	0.74	0.24	0.25	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.36	0.62	0.62	0.07%



투자주체별 매매 동향

(십억원)

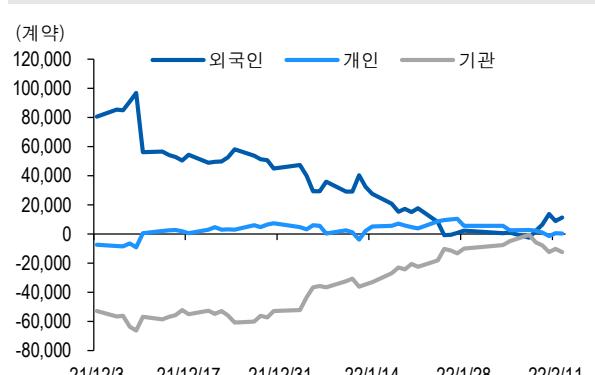
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	68.3	35.3	103.6	3.8	86.9	247.8	-39.8	-2.0	8.5	46.4
개인	-189.1	39.5	-149.5	0.0	-7.8	-26.6	2.5	-1.4	0.6	-8.6
기관	95.6	-69.4	26.2	43.4	9.0	-249.3	36.6	3.6	-8.9	-37.2
금융투자	40.2	-78.4	-38.2	-0.5	-5.7	248.3	38.0	3.5	-8.1	4.5
투신	-35.0	-6.3	-41.3	0.0	-50.5	-433.8	-1.5	0.0	0.0	3.8
은행+보험+기타금융	-5.7	9.5	3.8	0.0	-4.7	-33.5	0.1	0.1	-0.8	0.8
연기금+국가지자체	174.3	4.5	178.8	43.8	67.0	-30.3	0.0	0.0	0.0	-46.2
기타법인	25.2	-5.5	19.8	0.0	-1.3	28.2	0.6	-0.3	-0.2	-0.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	568,027	213.5	612,317	19.8%	지수옵션 전체	1,427,243	608.8	1,581,779
Put	859,216	395.3	969,462	21.6%	PCR(금액기준)	1.85	VKOSPI	23.84% (+2.92%p)
<hr/>								
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
	375.0(K+3)	3.11	-1.22	41,022	9,953	1,982	19.6	Put
	372.5(K+2)	3.96	-1.44	17,632	4,117	358	20.0	370.0(K+1)
	370.0(K+1)	4.95	-1.63	14,234	11,060	709	20.5	367.5(K+0)
	367.5(K+0)	6.15	-1.76	7,443	4,315	812	21.1	365.0(K-1)
	365.0(K-1)	7.39	-2.19	7,411	5,103	1,408	21.6	362.5(K-2)
	<hr/>							
	360.0(K-3)							

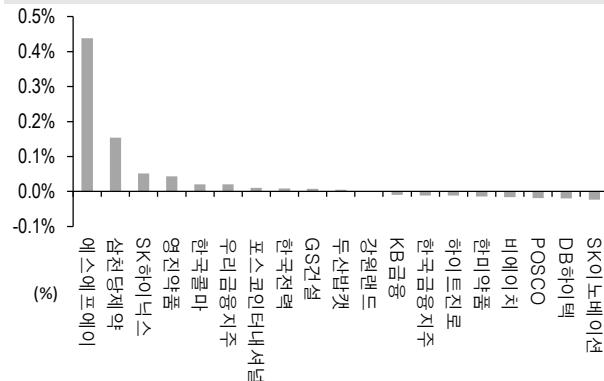
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)
주식선물 전체	4,100,403	3,072.2	4,470,705	136,587	71,457	-3,534	-68,869	46.4	-8.6	-37.2
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
넥센타이어	6,350	-2.61	1.7	226.1	4,134	115	-0.25%	-911	271	639
일진미터리얼즈	91,000	-4.21	35.5	109.1	131,343	-7,860	-0.21%	661	-7,643	6,982
삼성전자	73,800	-1.34	831.2	80.9	1,124,298	50,321	-0.09%	38,567	-10,981	-28,119
SK 하이닉스	133,000	0.76	516.6	79.7	239,861	1,093	0.05%	-4,108	5,658	-1,612
POSCO	284,500	-1.90	56.5	76.5	20,598	336	-0.02%	749	371	-1,144
NAVER	323,500	-1.22	102.2	74.8	29,807	234	-0.04%	1,622	344	-1,906
BGF	5,020	0.40	0.7	72.3	1,651	-908	-0.32%	-1,235	23	1,212
LG 이노텍	315,500	-1.87	62.7	70.2	9,995	-413	-0.04%	-236	1,051	-665
삼성전기	162,000	-3.57	59.3	68.5	24,648	-732	-0.18%	386	-1,830	1,442
현대제철	39,900	-1.97	13.7	68.0	11,487	2,643	-0.08%	-1,525	2,617	-1,165

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터