

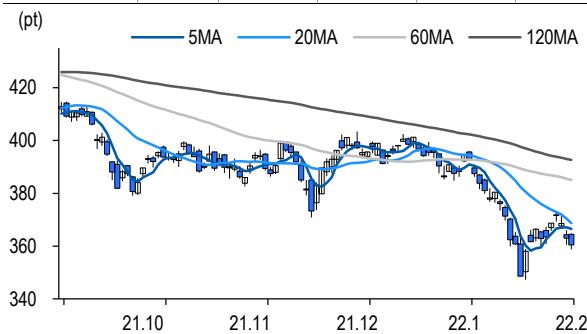


선물옵션시장 지표

2022.2.16

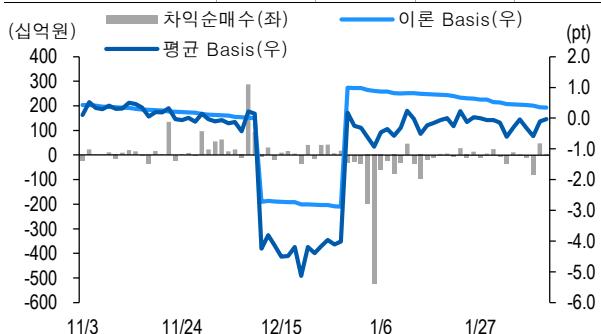
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	360.43	-0.70	-2.55	6,497.3	-
선물 3월물	360.55	-0.85	-3.10	25,212.2	266,269
선물 6월물	360.70	-0.85	-3.10	70.6	14,854
3월물(mini)	360.58	-0.85	-2.94	2,000.4	50,767
4월물(mini)	360.30	-0.74	-2.70	5.6	6,430



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.34	-0.03	0.12	-0.10%
베이시스(mini)	0.34	-0.03	0.15	-0.10%
제1스프레드(SP)	0.73	0.24	0.20	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.34	0.18	0.18	-0.04%



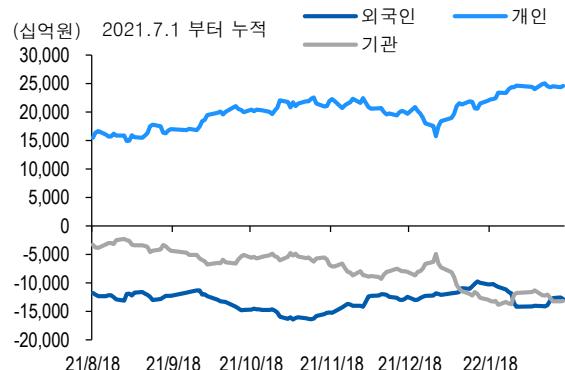
투자주체별 매매 동향

(십억원)

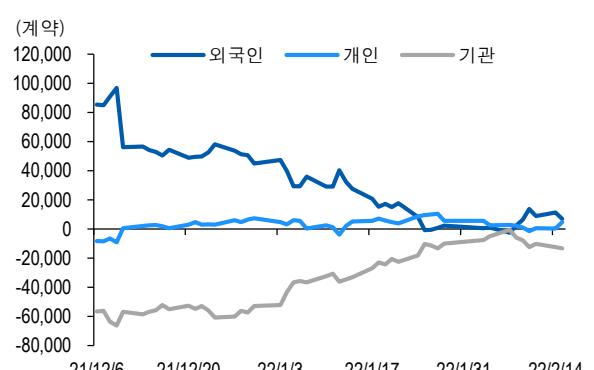
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-263.5	-14.4	-278.0	4.9	-151.0	-390.5	-0.4	-2.9	3.9	11.6
개인	183.3	40.5	223.8	0.0	-1.9	380.2	21.4	0.5	0.9	-17.2
기관	66.0	-28.8	37.2	-0.7	19.4	-63.5	-22.3	2.7	-4.4	5.9
금융투자	182.5	-28.1	154.4	0.9	7.4	-24.9	-20.3	3.3	-3.3	29.1
투신	-1.5	0.9	-0.6	0.0	20.3	-36.1	-1.8	-0.2	-0.1	-10.4
은행+보험+기타금융	-5.2	-2.4	-7.6	0.0	-4.1	-2.8	-0.2	-0.4	-1.0	-3.8
연기금+국가지자체	-16.8	1.5	-15.3	-1.6	-2.1	0.4	0.0	0.0	0.0	-9.1
기타법인	14.3	2.7	17.0	0.0	-0.6	73.8	1.3	-0.3	-0.4	-0.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	498,827	177.6	654,535	20.3%	지수옵션 전체	1,156,002	474.9	1,662,399
Put	657,175	297.2	1,007,864	23.2%	PCR(금액기준)	1.67	VKOSPI	24.62% (+0.78%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	370.0(K+3)	3.80	-1.15	14,154	11,744	684	20.2	365.0(K+1)
	367.5(K+2)	4.78	-1.37	6,916	4,541	226	20.6	362.5(K+0)
	365.0(K+1)	5.92	-1.47	5,081	5,874	771	21.2	360.0(K-1)
	362.5(K+0)	7.20	-1.62	3,664	3,842	866	21.7	357.5(K-2)
	360.0(K-1)	8.59	-1.76	1,352	5,235	449	22.2	355.0(K-3)
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	365.0(K+1)	10.35	1.61	2,905	6,651	165	21.8	362.5(K+0)
	362.5(K+0)	9.09	1.43	3,988	8,781	294	22.2	360.0(K-1)
	360.0(K-1)	7.97	1.25	6,189	26,169	-99	22.7	357.5(K-2)
	357.5(K-2)	7.00	1.13	5,587	6,824	482	23.3	355.0(K-3)
	355.0(K-3)	6.13	0.98	10,181	11,018	436	23.8	

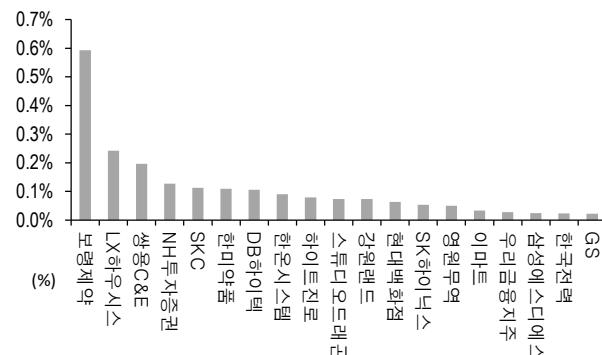
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	3,628,130	2,711.6	4,494,480	23,775	33,716	-51,855	18,082	11.6	-17.2	5.9
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
다우기술	20,650	-0.96	2.2	190.3	2,388	732	-0.10%	217	139	-356
일진머티리얼즈	90,800	-0.22	30.0	127.4	131,242	-101	-0.10%	3,342	-2,966	-376
메리츠증권	5,940	-2.46	7.9	110.2	65,687	22,421	-0.77%	6,509	-5,533	-976
SK 하이닉스	127,000	-4.51	581.5	89.0	240,523	662	0.05%	6,358	10,244	-16,447
삼성전자	73,600	-0.27	575.4	84.1	1,103,435	-20,863	-0.12%	-704	-10,949	11,383
LG 화학	626,000	0.16	137.3	78.4	11,553	63	-0.03%	-230	305	-71
호텔신라	78,100	-0.89	18.0	73.9	38,372	566	-0.10%	1,285	-982	-303
현대제철	39,250	-1.63	10.4	72.6	13,442	1,955	-0.07%	-378	1,659	-1,281
넥센타이어	6,350	0.00	0.8	71.2	4,925	791	-0.03%	-201	-4	205
POSCO	280,000	-1.58	67.0	70.9	20,737	139	0.01%	519	-268	-297

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터