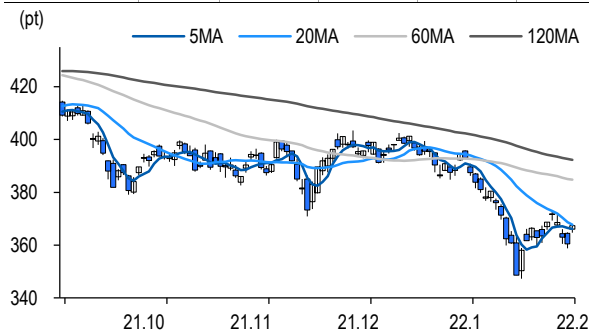


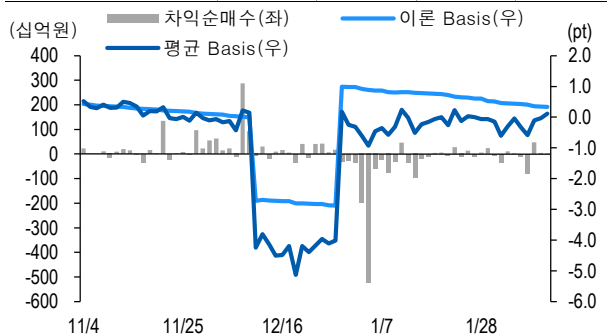
선물옵션시장 지표

2022.2.17

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	367.30	1.91	6.87	5,884.2	-
선물 3월물	367.35	1.89	6.80	19,637.2	268,557
선물 6월물	367.50	1.89	6.80	121.9	15,823
3월물(mini)	367.30	1.87	6.72	1,552.8	49,509
4월물(mini)	366.90	1.83	6.60	1.6	6,441



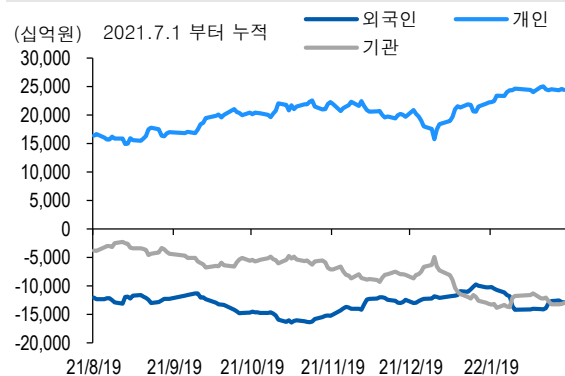
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.33	0.11	0.05	-0.06%
베이스(mini)	0.33	0.10	0.00	-0.06%
제1스프레드(SP)	0.75	0.20	0.20	-0.15%
합성선물 베이스(ATM)	0.33	0.02	0.02	-0.08%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-44.6	18.2	-26.4	4.9	-30.1	419.5	77.7	5.7	-1.5	8.5
개인	-208.0	6.6	-201.4	0.0	7.7	-478.6	-43.4	-4.2	-0.5	-7.9
기관	225.6	-23.1	202.5	-1.6	-3.1	178.8	-31.3	-1.6	1.9	1.4
금융투자	242.2	-46.9	195.3	-5.2	-0.2	-396.1	-27.7	-1.7	2.9	6.6
투신	33.3	18.4	51.6	0.0	11.8	594.6	-3.7	0.0	0.0	15.1
은행+보험+기타금융	-12.6	8.4	-4.2	0.0	-4.4	-16.6	0.1	0.1	-0.9	0.2
연기금+국가지자체	-0.3	-8.9	-9.2	3.5	-9.1	-3.1	0.0	0.0	0.0	-20.5
기타법인	27.0	-1.8	25.3	0.0	0.7	-119.7	-3.0	0.1	0.1	-2.0

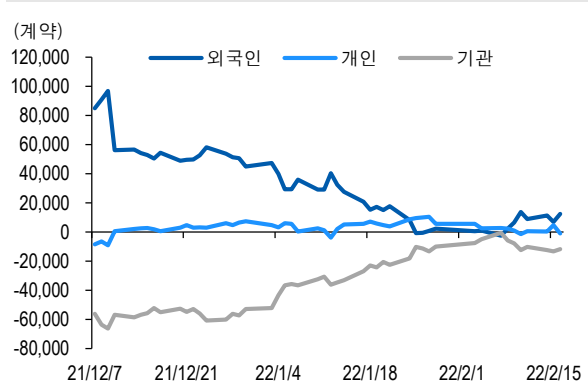
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	498,253	194.2	682,361	19.0%	지수옵션 전체	947,747	372.5	1,725,846
Put	449,494	178.2	1,043,485	22.6%	PCR(금액기준)	0.92	VKOSPI	21.94%(-2.68%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	367.5(K+3)	7.04	2.26	5,873	4,682	141	18.9	Put	362.5(K+1)	5.36	-3.73	5,084	8,980	199	21.0
	365.0(K+2)	8.61	2.69	4,028	6,243	369	19.7		360.0(K+0)	4.63	-3.34	8,308	26,734	565	21.6
	362.5(K+1)	10.20	3.00	1,963	3,927	85	20.1		357.5(K-1)	3.91	-3.09	6,298	6,712	-112	22.0
	360.0(K+0)	11.95	3.36	690	5,196	-39	20.7		355.0(K-2)	3.38	-2.75	15,226	10,833	-185	22.7
	357.5(K-1)	13.55	3.35	128	788	14	20.4		352.5(K-3)	2.88	-2.50	15,484	5,865	416	23.2

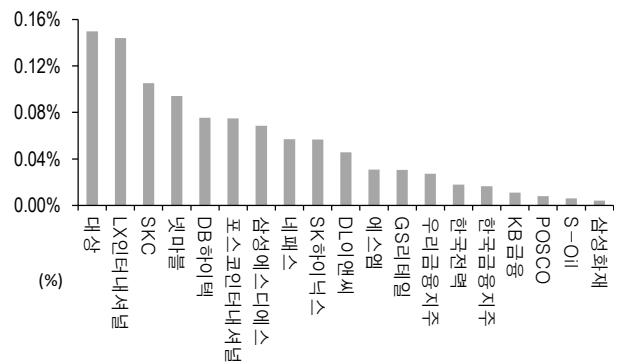
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	2,727,486	2,198.0	4,583,645	89,165	26,697	-48,645	26,504	8.5	-7.9	1.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	93,400	2.86	20.9	107.6	132,145	903	-0.08%	-117	2,027	-1,910	-1,252	-658
메리츠증권	6,110	2.86	6.4	97.0	71,428	5,741	-0.57%	-5,950	-6,932	12,882	7,879	0
SK 하이닉스	130,500	2.76	336.1	74.4	247,129	6,606	0.06%	-6,809	-1,624	8,004	-6,654	1,180
삼성전자	74,800	1.63	543.3	67.9	1,122,672	19,237	-0.05%	-13,484	1,737	12,027	17,328	-9,050
LG 이노텍	318,000	1.27	60.2	62.8	10,961	-322	-0.11%	50	221	-275	627	308
엔씨소프트	493,000	-1.40	158.1	60.5	11,316	682	-0.02%	370	-128	-198	-119	-80
LG 화학	654,000	4.47	122.5	55.4	12,311	758	-0.10%	978	-1,303	343	209	331
다우기술	20,850	0.97	0.7	54.8	2,443	55	-0.25%	704	23	-728	-728	0
POSCO	280,500	0.18	35.8	53.3	20,818	81	0.01%	101	62	-197	3	-200
현대위아	65,700	2.98	4.6	52.9	5,721	-179	-0.02%	-26	117	-91	-1,845	-1,042

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터