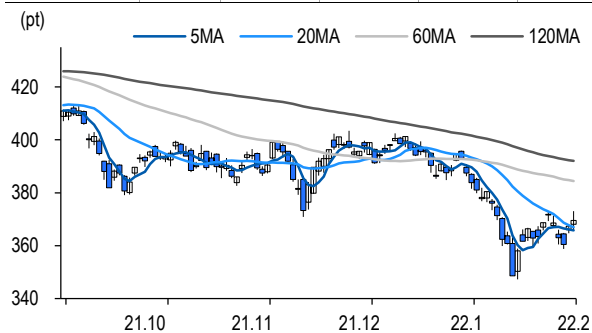


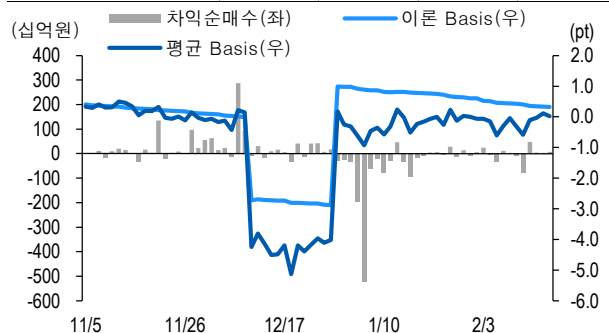
## 선물옵션시장 지표

2022.2.18

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	369.55	0.61	2.25	8,545.2	-
선물 3월물	370.20	0.78	2.85	39,431.9	271,415
선물 6월물	370.25	0.75	2.75	243.6	16,517
3월물(mini)	370.22	0.78	2.92	2,672.7	48,443
4월물(mini)	369.50	0.71	2.60	8.7	6,441



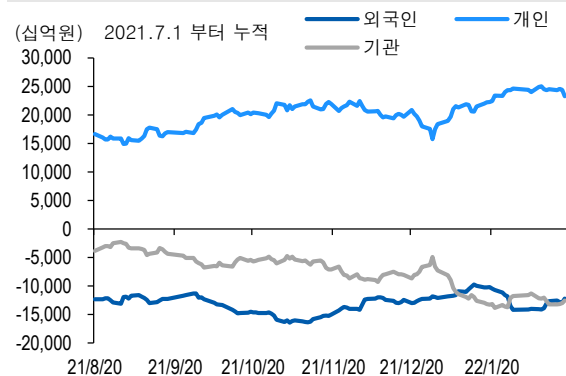
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.32	0.02	0.65	-0.08%
베이스(mini)	0.32	0.02	0.67	-0.08%
제1스프레드(SP)	0.77	0.19	0.15	-0.16%
합성선물 베이스(ATM)	0.32	0.66	0.66	0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	649.2	-13.3	635.9	6.2	353.0	287.1	16.0	2.0	-6.0	16.6
개인	-1,098.5	15.1	-1,083.4	0.0	4.7	-60.1	-8.8	0.7	5.4	0.9
기관	434.7	-5.1	429.6	1.4	136.1	-290.7	-6.5	-3.2	0.6	-16.3
금융투자	106.6	-5.7	100.9	1.2	16.1	-62.9	-5.3	-2.4	0.7	-15.1
투신	196.4	14.6	210.9	0.0	120.6	-197.4	-1.0	0.1	0.0	-2.5
은행+보험+기타금융	9.2	-15.3	-6.1	0.0	-3.0	-35.9	-0.2	-1.0	-0.1	0.2
연기금+국가지자체	57.9	-1.3	56.6	0.3	-4.3	5.6	0.0	0.0	0.0	1.2
기타법인	14.6	3.3	17.9	0.0	-4.8	63.7	-0.7	0.5	0.1	-1.2

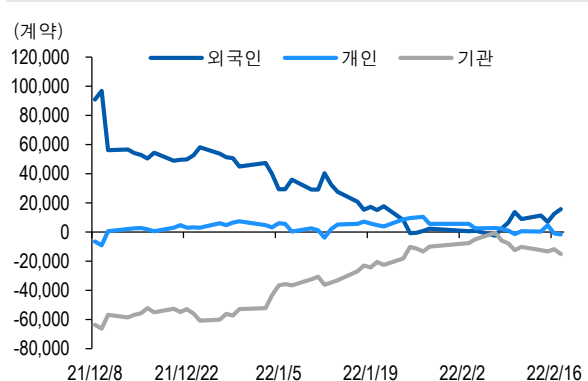
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	1,027,650	441.2	705,055	19.9%	지수옵션 전체	2,310,260	922.3	1,828,520
Put	1,282,610	481.1	1,123,465	22.3%	PCR(금액기준)	1.09	VKOSPI	23.28%(+1.34%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	375.0(K+3)	4.96	1.40	30,779	12,121	-74	19.8	Put	370.0(K+1)	7.36	-1.04	12,740	16,166	3,397	20.2
	372.5(K+2)	6.20	1.65	15,407	6,032	671	20.5		367.5(K+0)	6.40	-0.85	12,937	5,287	1,801	20.9
	370.0(K+1)	7.59	1.85	13,755	11,653	231	21.1		365.0(K-1)	5.56	-0.66	14,976	8,563	845	21.6
	367.5(K+0)	9.11	2.07	6,755	4,924	242	21.8		362.5(K-2)	4.79	-0.57	13,480	9,192	212	22.2
	365.0(K-1)	10.65	2.04	4,208	5,693	-550	22.2		360.0(K-3)	4.21	-0.42	38,752	30,733	3,999	23.0

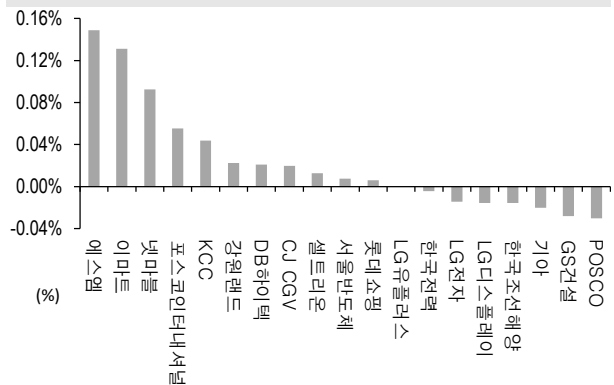
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물 평균베이스스 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	4,573,697	3,603.6	4,605,399	21,754	25,183	-14,764	-6,800	16.6	0.9	-16.3

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
일진머티리얼즈	93,600	0.21	29.8	106.6	131,715	-430	-0.11%	-1,185	412	773	241	536
메리츠증권	6,170	0.98	6.5	85.9	73,261	1,833	-0.41%	-10,226	-1,291	11,517	-5,939	-1,000
삼성전기	166,500	-0.30	75.5	83.3	26,174	2,441	-0.03%	-18	1,147	-1,129	-387	-751
현대차	183,500	0.55	117.0	82.9	43,228	933	-0.13%	1,265	1,544	-2,805	-2,605	-30
삼성전자	75,300	0.67	805.3	78.9	1,134,616	11,944	-0.09%	9,532	-14,021	4,872	14,838	-12,602
LG 이노텍	325,000	2.20	145.2	75.3	10,643	-318	-0.04%	512	-397	-115	-632	357
LG 전자	124,500	0.81	93.4	74.9	26,308	1,053	-0.01%	3,903	263	-4,055	-672	-3,398
SK 하이닉스	133,000	1.92	522.8	73.3	234,802	-12,327	-0.27%	8,018	-11,267	3,434	15,013	2,969
LG 화학	645,000	-1.38	131.4	69.1	12,431	120	-0.08%	-208	650	-465	-338	-4
셀트리온헬스케어	63,000	2.44	33.6	69.0	29,248	-13,609	-0.13%	197	-1,870	2,437	-14,128	0

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터