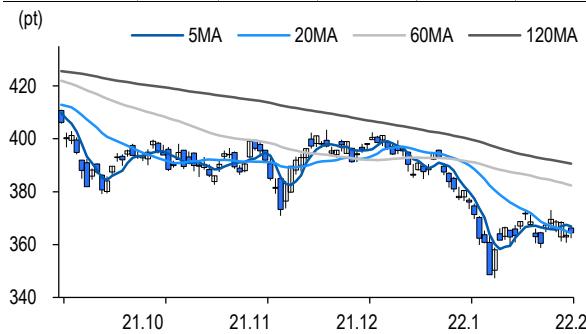


선물옵션시장 지표

2022.2.24

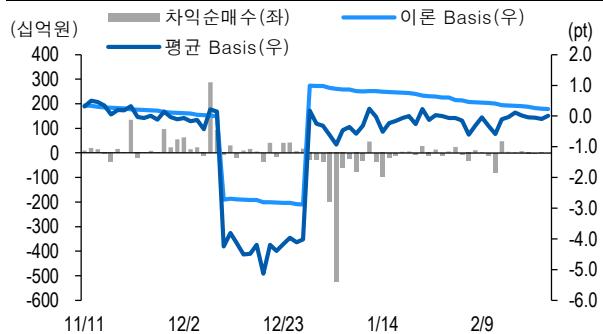
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	364.44	0.26	0.93	6,036.0	-
선물 3월물	364.05	0.12	0.45	20,924.5	274,550
선물 6월물	364.10	0.05	0.20	251.1	16,988
3월물(mini)	364.10	0.14	0.48	1,820.3	49,084
4월물(mini)	364.24	0.29	1.06	7.7	8,609



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.22	0.01	-0.39	-0.06%
베이시스(mini)	0.22	0.01	-0.34	-0.06%
제1스프레드(SP)	0.75	0.24	0.25	-0.14%
합성선물 베이시스(ATM)	0.22	-0.35	-0.35	-0.16%



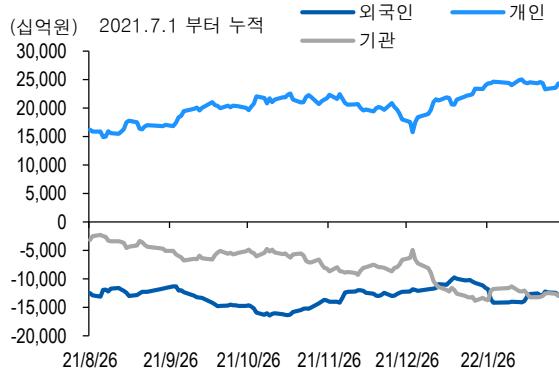
투자주체별 매매 동향

(십억원)

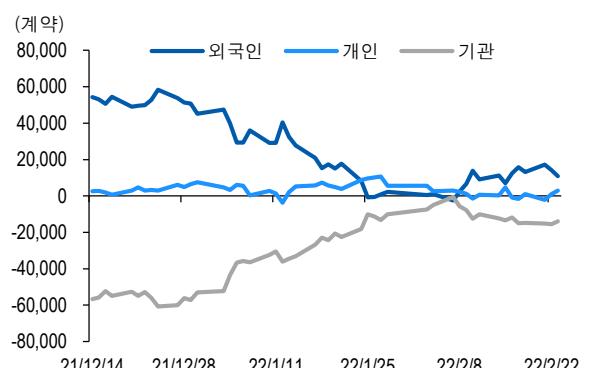
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-266.7	12.0	-254.7	0.8	-132.8	-308.9	4.3	-1.2	0.5	9.3
개인	75.5	-12.5	63.0	0.0	-8.8	159.9	13.2	1.3	-2.5	30.9
기관	179.0	-0.1	178.8	0.0	-52.6	168.5	-16.6	0.0	2.2	-40.6
금융투자	176.7	-7.8	168.9	1.7	7.5	-224.0	-16.2	0.8	1.0	-22.1
투신	-17.2	-2.5	-19.7	0.0	-17.1	372.9	-0.4	-0.1	0.0	9.6
은행+보험+기타금융	-12.4	11.7	-0.7	0.0	-18.6	17.5	0.0	-0.8	1.2	0.7
연기금+국가지자체	27.3	-6.5	20.8	-1.7	-23.5	2.0	0.0	0.0	0.0	-28.8
기타법인	12.2	0.6	12.9	0.0	-1.5	-19.5	-0.9	0.0	-0.2	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

								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	574,347	200.4	810,535	20.5%	지수옵션 전체		1,302,377	446.8	2,046,438		
Put	728,030	246.4	1,235,903	24.7%	PCR(금액기준)		1.23	VKOSPI	24.07%(-1.27%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	370.0(K+3)	3.97	-0.34	17,939	13,283	356	20.5	365.0(K+1)	7.25	-0.77	4,033
	367.5(K+2)	5.07	-0.32	7,904	7,071	489	20.9	362.5(K+0)	6.14	-0.79	5,293
	365.0(K+1)	6.33	-0.32	4,784	6,245	182	21.3	360.0(K-1)	5.20	-0.78	10,340
	362.5(K+0)	7.73	-0.32	3,197	4,703	295	21.7	357.5(K-2)	4.38	-0.77	6,847
	360.0(K-1)	9.47	-0.12	1,028	5,360	62	22.8	355.0(K-3)	3.68	-0.75	22,996
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	365.0(K+1)	7.25	-0.77	4,033	8,083	-51	23.3	362.5(K+0)	6.14	-0.79	5,293
	360.0(K-1)	5.20	-0.78	10,340	22,554	-204	24.1	357.5(K-2)	4.38	-0.77	6,847
	355.0(K-3)	3.68	-0.75	22,996	14,845	-379	24.6	355.0(K-3)	3.68	-0.75	22,996
	355.0(K-3)	3.68	-0.75	22,996	14,845	-386	25.1	355.0(K-3)	3.68	-0.75	22,996
	355.0(K-3)	3.68	-0.75	22,996	14,845	-386	25.1	355.0(K-3)	3.68	-0.75	22,996

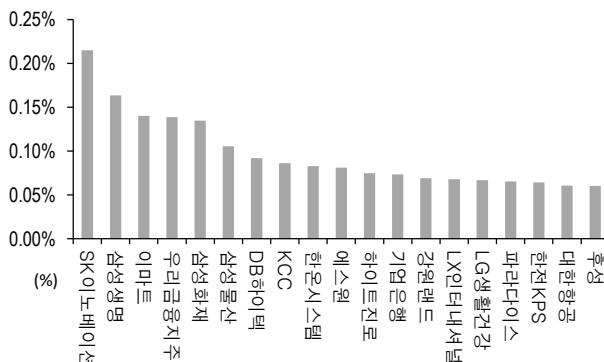
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	금융투자	연기금등	
주식선물 전체	2,621,151	1,999.9	4,724,713	94,501	7,633	50,434	-59,789	9.3	30.9	-40.6			
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수	
SK 하이닉스	128,500	0.00	296.7	85.6	216,987	2,752	-0.06%	3,073	-1,479	-1,596	-3,880	-239	
넥센타이어	6,400	-1.39	0.4	79.2	3,882	-302	-0.05%	-458	29	429	429	0	
일진마티리얼즈	92,500	0.87	9.4	76.2	127,548	-120	-0.15%	-102	-119	166	259	-93	
삼성전자	73,200	-0.27	492.0	65.0	1,136,192	16,112	-0.08%	-13,776	25,696	-11,999	5,186	-17,200	
DGB 금융지주	9,440	-0.21	1.9	64.0	14,046	1,851	-0.01%	852	1,452	-2,304	-2,304	0	
한국조선해양	88,800	6.22	23.9	60.5	11,288	4,691	0.01%	2,561	-3,672	1,111	-947	6	
LG 이노텍	335,000	6.01	103.3	59.9	16,930	5,053	0.05%	393	-1,669	1,277	-2,310	-1,503	
현대제철	39,750	1.27	10.4	58.5	21,299	2,228	0.02%	2,002	933	-2,934	-2,707	-229	
KB 금융	62,500	-0.32	30.1	57.7	56,092	-4,169	0.05%	-2,394	1,050	1,344	-1,518	2,884	
SK 이노베이션	202,500	0.75	31.8	52.9	16,518	418	0.21%	773	377	-1,157	-1,280	-1,625	

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터