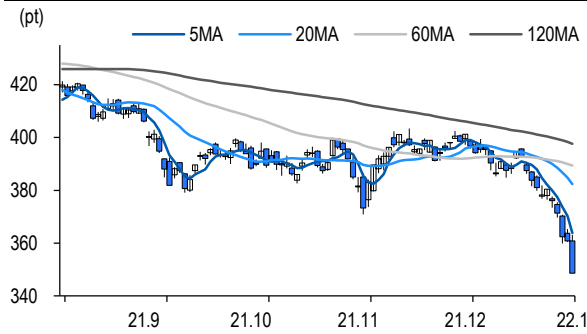


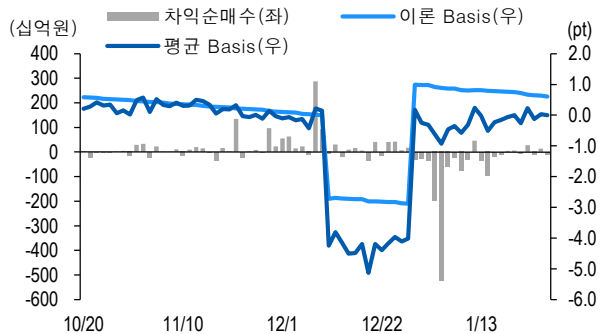
선물옵션시장 지표

2022.1.28

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	348.58	-3.39	-12.25	9,825.2	-
선물 3월물	347.45	-3.67	-13.25	45,779.5	284,956
선물 6월물	347.80	-3.63	-13.10	44.3	12,612
2월물(mini)	347.52	-3.69	-13.30	3,413.3	56,087
3월물(mini)	347.52	-3.65	-13.36	17.9	4,202

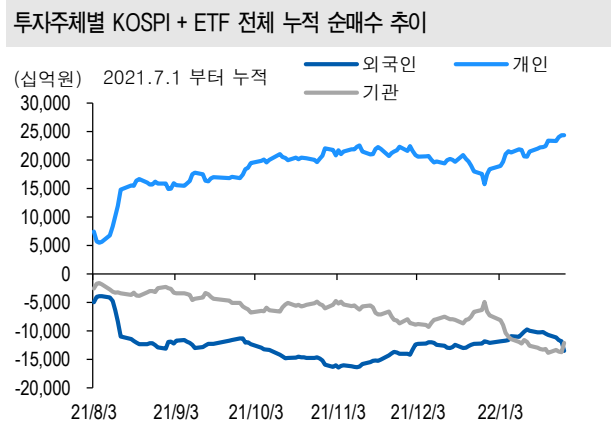


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.60	0.00	-1.13	-0.17%
베이스스(mini)	0.20	0.12	-1.06	-0.02%
제1스프레드(SP)	0.68	0.27	0.20	-0.12%
합성선물 베이스스(ATM)	0.20	-0.69	-0.69	-0.26%

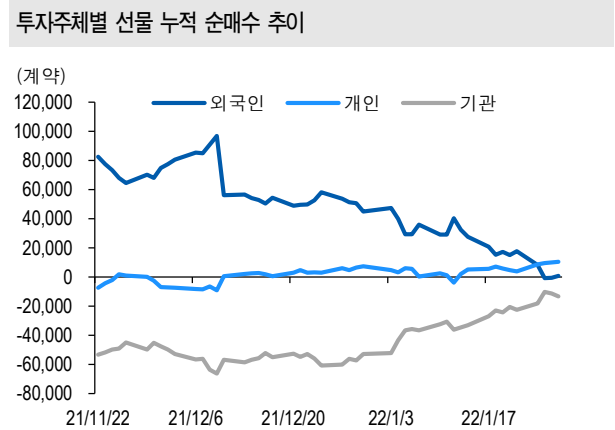


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-1,628.7	-46.8	-1,675.5	-0.5	-218.4	-61.5	187.3	-4.3	-10.6	33.5
개인	-168.9	210.8	41.8	0.0	8.5	24.4	12.3	-1.5	26.0	-69.1
기관	1,801.9	-179.2	1,622.7	-8.8	-548.9	20.8	-191.4	6.8	-16.7	37.6
금융투자	57.4	-101.2	-43.8	4.0	-2.7	580.6	-192.5	7.4	-14.6	5.2
투신	200.3	-78.7	121.6	0.0	-57.5	-297.8	1.2	0.1	0.1	30.4
은행+보험+기타금융	143.2	8.8	152.0	0.0	-57.0	63.9	0.0	-0.7	-2.2	-0.7
연기금+국가지자체	1,223.0	7.7	1,230.7	-13.7	-430.9	-325.9	0.0	0.0	0.0	2.8
기타법인	-4.3	15.3	11.0	0.0	0.6	16.3	-8.2	-1.0	1.3	-1.9

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



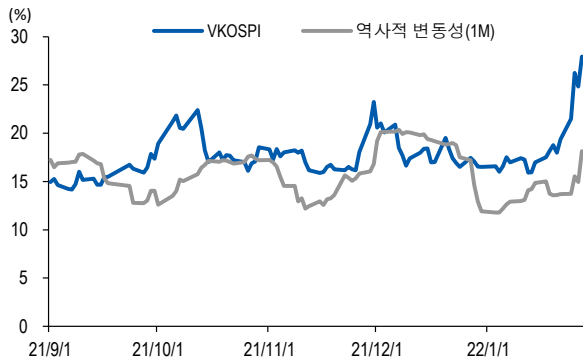
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향				(계약, 십억원)				
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,466,231	372.9	949,539	22.0%	지수옵션 전체	3,300,242	1,247.1	2,176,808
Put	1,834,011	874.2	1,227,269	27.7%	PCR(금액기준)	2.34	VKOSPI	27.94%(+3.11%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	367.5(K+3)	0.91	-2.82	127,004	11,887	8,590	21.7	Put	362.5(K+1)	16.50	8.81	3,201	10,285	-716	27.2
	365.0(K+2)	1.30	-3.50	100,104	12,010	8,318	22.1		360.0(K+0)	14.55	8.00	9,412	15,667	-2,884	26.8
	362.5(K+1)	1.76	-4.26	53,573	8,319	6,372	22.3		357.5(K-1)	12.90	7.36	10,308	12,401	-641	27.3
	360.0(K+0)	2.44	-4.91	42,844	8,437	6,934	23.0		355.0(K-2)	11.45	6.76	16,724	17,330	-440	28.0
	357.5(K-1)	3.12	-5.73	18,042	3,501	3,314	23.0		352.5(K-3)	9.80	5.85	21,394	14,842	119	27.6

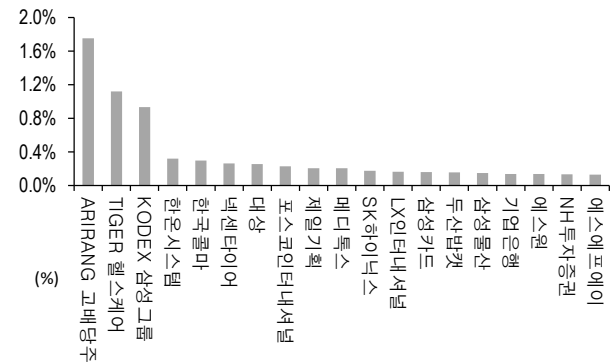
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	5,139,884	4,401.9	5,244,718	37,734	34,735	-58,795	22,044	33.5	-69.1	37.6

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	114,000	-2.56	595.7	78.4	175,476	20,510	0.18%	250	6,404	-6,528	-18,151	-3,935
하나금융지주	44,000	-0.90	46.2	77.1	99,594	-503	0.00%	-2,086	293	1,283	-2,342	3,622
LG 이노텍	332,000	0.30	196.0	74.1	17,571	2,466	0.01%	318	-4	-308	-731	-601
삼성전자	71,500	-2.72	1,143.3	71.5	1,180,426	-3,883	-0.01%	9,297	-19,643	10,720	5,963	350
삼성전기	171,000	-2.29	107.8	71.2	38,708	-3,242	-0.11%	456	1,254	-1,713	-2,588	875
현대제철	38,300	-4.01	20.0	68.3	10,635	189	-0.12%	-2,688	-1,364	4,052	2,696	1,356
현대위아	64,600	-3.87	11.5	66.1	5,898	579	-0.27%	98	-1,157	1,059	2,287	1,568
LG 화학	608,000	-7.88	322.7	59.7	18,473	1,377	-0.25%	1,614	-853	-553	837	-877
POSCO	258,000	-4.62	68.3	57.1	26,468	1,627	0.12%	352	565	-1,121	220	-1,339
KB 금융	58,000	-1.86	47.0	56.7	42,123	-6,114	0.04%	-6,099	3,068	2,963	906	2,069

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터