

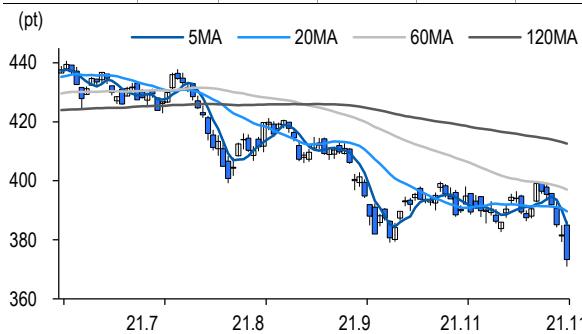


선물옵션시장 지표

2021.12.1

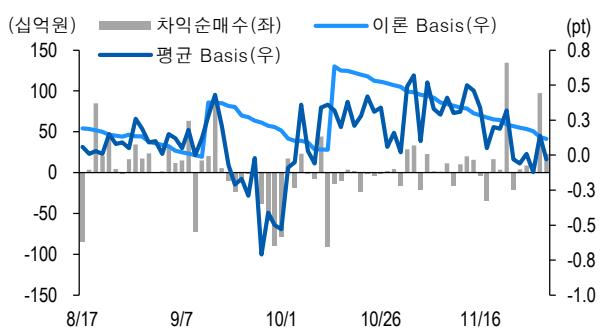
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	373.24	-2.20	-8.39	15,430.7	-
선물 12월물	373.35	-2.25	-8.60	39,097.5	292,126
선물 3월물	369.30	-2.39	-9.05	383.2	14,790
12월물(mini)	373.22	-2.29	-8.72	2,560.0	51,220
1월물(mini)	369.32	-2.17	-8.20	14.8	1,565



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.12	-0.03	0.11	-0.04%
베이시스(mini)	0.12	-0.03	-0.02	-0.04%
제1스프레드(SP)	-2.82	-3.89	-3.90	-0.29%
합성선물 베이시스(ATM)	0.12	0.25	0.25	0.04%



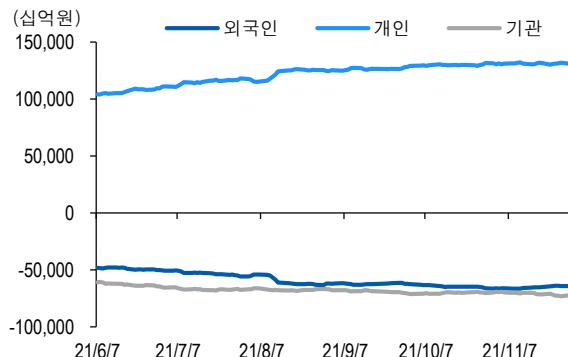
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-137.2	-32.0	-169.2	-3.4	-314.1	-153.0	-70.1	1.3	-10.0	-10.4
개인	736.7	84.9	821.6	0.0	0.4	-304.0	60.3	-2.9	16.7	-80.8
기관	-636.6	-53.3	-689.9	26.7	-18.6	439.1	6.2	2.2	-8.2	91.7
금융투자	-427.1	-172.2	-599.3	44.2	-1.9	471.0	6.2	3.2	-7.2	85.2
투신	-32.3	-5.9	-38.2	0.0	-34.1	12.0	0.1	-0.5	-0.4	-22.8
은행+보험+기타금융	5.6	120.7	126.3	0.0	22.2	-60.7	-0.1	-0.4	-0.5	0.0
연기금+국가지자체	-102.5	2.2	-100.3	-17.4	-6.1	16.9	0.0	0.0	0.0	29.4
기타법인	37.0	0.5	37.5	0.0	-0.2	17.9	3.5	-0.6	1.5	-0.5

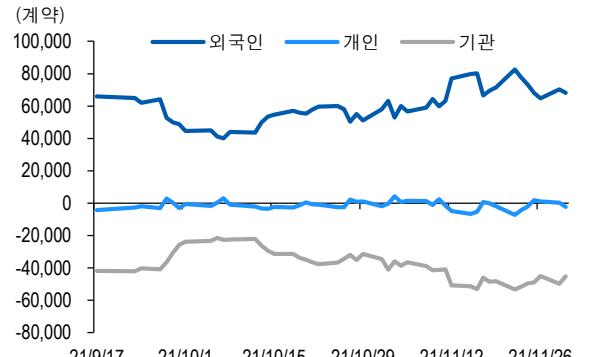
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	1,262,830	304.5	938,889	20.5%	지수옵션 전체		3,668,598	1,122.2	2,535,156					
Put	2,405,768	817.7	1,596,267	22.4%	PCR(금액기준)		2.69	VKOSPI	23.23% (+2.31%p)					
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
	390.0(K+3)	0.54	-1.38	185,318	23,528	7,166	19.9	385.0(K+1)	12.65	5.96	11,634	18,711	-1,103	18.9
	387.5(K+2)	0.89	-1.81	116,078	12,306	4,113	20.5	382.5(K+0)	11.00	5.51	15,586	13,589	-580	20.9
	385.0(K+1)	1.30	-2.56	96,453	12,017	4,757	20.6	380.0(K-1)	9.35	4.91	51,388	30,802	-3,784	21.7
	382.5(K+0)	1.99	-3.04	61,154	6,979	4,511	21.5	377.5(K-2)	7.88	4.23	53,337	13,651	-1,049	22.5
	380.0(K-1)	2.87	-3.66	40,963	8,541	5,121	22.4	375.0(K-3)	6.50	3.55	98,459	19,972	-2,779	22.9

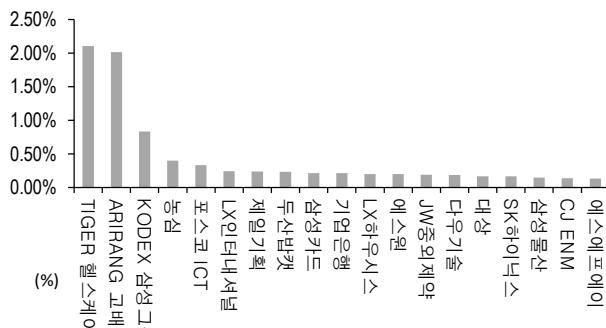
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	순매수
주식선물 전체	5,346,696	4,203.9	4,988,450	-4,403	9,474	-115,694	110,126	-10.4	-80.8	91.7			
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인	개인	기관	금융투자	연기금등	순매수
SK 하이닉스	114,500	-2.14	519.4	69.7	143,570	12,097	0.17%	8,949	4,133	-13,433	-21,704	1,577	
삼성전자	71,500	-1.38	1,325.9	62.1	1,119,860	-95,404	0.08%	-20,280	-45,737	66,278	39,427	22,215	
LG 이노텍	305,000	4.27	152.0	55.8	9,687	810	-0.01%	463	169	-629	554	-1,563	
엔씨소프트	682,000	-1.16	126.3	53.1	9,869	179	0.02%	13	451	-464	-173	-645	
LG 디스플레이	19,800	-3.65	43.4	44.6	301,455	-10,032	0.02%	17,412	-25,316	7,904	4,252	3,653	
POSCO	261,500	-1.13	66.2	44.3	15,441	-1,400	0.02%	-349	-1,091	1,540	-764	2,304	
삼성전기	167,000	-2.05	61.7	42.2	27,930	-7,582	-0.01%	-462	-5,075	5,537	1,599	3,903	
롯데케미칼	202,000	0.50	20.9	40.4	3,771	416	-0.10%	-191	538	-347	699	190	
아모레퍼시픽	156,500	-6.01	23.8	38.9	12,888	2,256	-0.57%	-521	207	314	3,083	595	
대한항공	26,500	-0.56	29.2	38.8	54,927	-2,629	0.10%	3,086	583	-3,669	-7,946	2,608	

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터