

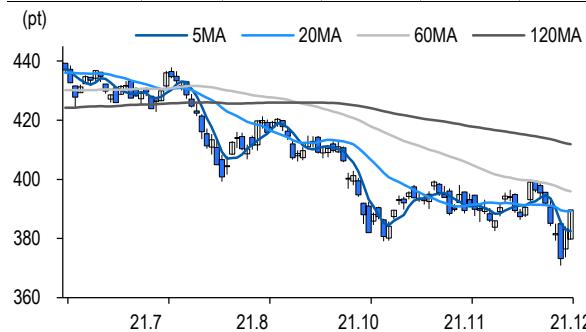


## 선물옵션시장 지표

2021.12.3

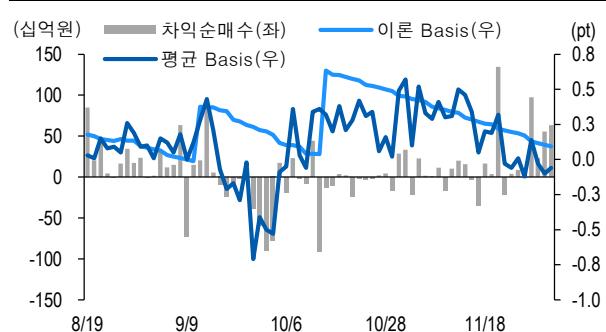
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	389.64	1.70	6.51	9,560.2	-
선물 12월물	389.00	1.57	6.00	35,201.7	277,848
선물 3월물	385.20	1.53	5.80	348.2	16,865
12월물(mini)	388.96	1.56	5.98	2,089.1	55,215
1월물(mini)	384.62	1.50	5.70	17.8	4,722



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.09	-0.06	-0.64	-0.04%
베이시스(mini)	0.09	-0.06	-0.68	-0.04%
제1스프레드(SP)	-2.75	-3.87	-3.80	-0.29%
합성선물 베이시스(ATM)	0.09	-0.59	-0.59	-0.18%



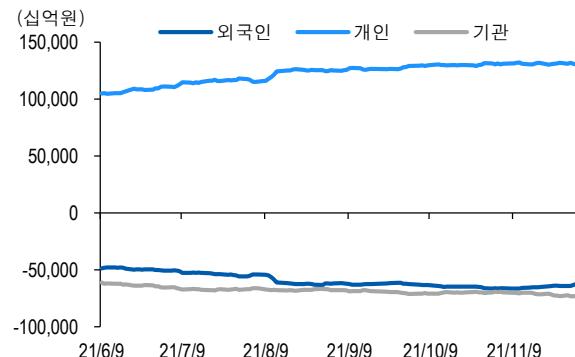
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	885.8	-19.7	866.0	0.0	601.1	155.9	87.9	3.4	3.1	-22.4
개인	-919.7	194.5	-725.2	0.0	0.6	36.4	-59.3	1.5	-2.4	33.3
기관	2.1	-163.5	-161.4	63.3	53.7	-201.6	-11.2	-5.6	0.7	-11.5
금융투자	-12.3	-234.5	-246.8	78.1	10.6	-415.6	-10.8	-5.5	1.7	26.5
투신	29.0	3.8	32.8	0.0	12.7	222.5	-0.5	-0.3	-0.3	-46.8
은행+보험+기타금융	-5.1	77.3	72.2	0.0	-6.4	-24.2	0.1	0.2	-0.7	0.1
연기금+국가지자체	36.5	-3.5	33.1	-14.8	31.3	15.6	0.0	0.0	0.0	8.7
기타법인	31.8	-11.3	20.5	0.0	0.0	9.2	-17.4	0.6	-1.5	0.6

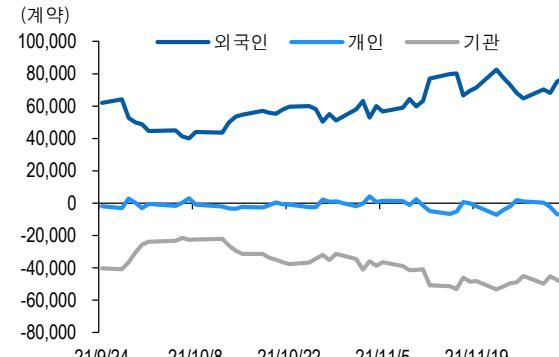
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	1,740,624	473.4	986,383	17.6%	지수옵션 전체	3,336,356	840.6	2,684,973							
Put	1,595,732	367.2	1,698,590	24.2%	PCR(금액기준)	0.78	VKOSPI	21.02% (+0.45%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	390.0(K+3)	3.90	2.38	154,967	23,418	-1,283	17.5	Put	385.0(K+1)	2.93	-2.44	26,103	19,265	834	21.6
	387.5(K+2)	5.33	2.97	65,793	13,846	-572	17.9		382.5(K+0)	2.29	-1.92	29,790	14,722	709	22.4
	385.0(K+1)	7.01	3.60	46,860	13,914	-49	18.4		380.0(K-1)	1.78	-1.49	68,408	31,605	931	23.3
	382.5(K+0)	8.84	4.10	11,062	8,866	-456	18.8		377.5(K-2)	1.37	-1.17	64,886	15,632	2,567	24.0
	380.0(K-1)	10.75	4.44	3,600	9,462	-298	18.5		375.0(K-3)	1.11	-0.85	98,722	24,695	4,492	25.2

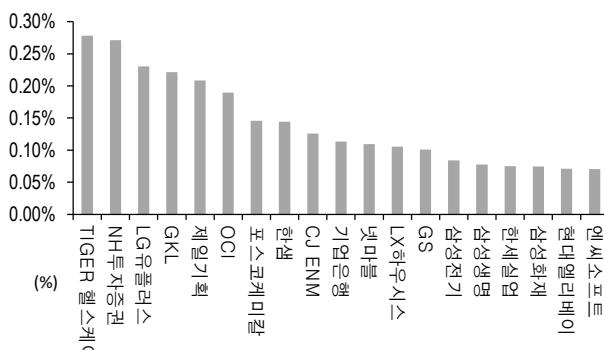
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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)
주식선물 전체	4,660,209	3,972.9	5,092,698	33,226	2,869	11,134	-14,988	-22.4	33.3	-11.5
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
엔씨소프트	693,000	-1.70	127.8	81.4	10,011	529	0.07%	-547	853	-307
삼성전자	75,900	2.29	1,412.1	79.8	1,178,624	18,667	0.04%	-15,863	34,830	-19,427
현대건설	47,350	4.30	16.7	75.1	15,366	823	-0.01%	-1,171	3,809	-2,638
SK 하이닉스	119,500	2.58	554.8	68.0	144,269	-8,042	-0.11%	10,587	-658	-10,249
기아	81,800	0.86	72.8	67.7	45,972	-2,248	0.05%	329	-4,149	3,820
대한항공	27,750	0.73	34.2	59.9	55,651	157	0.02%	2,748	-620	-2,078
현대차	204,500	2.00	87.9	55.3	38,797	-3,264	-0.02%	-3,765	-722	4,487
GS 건설	39,150	3.98	8.4	52.9	35,179	-608	0.03%	-1,325	7,088	-5,763
LG 화학	729,000	1.11	101.2	52.4	9,210	698	0.03%	291	234	-525
KB 금융	54,800	1.86	25.4	50.5	27,836	-918	-0.15%	503	683	-1,192

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터