

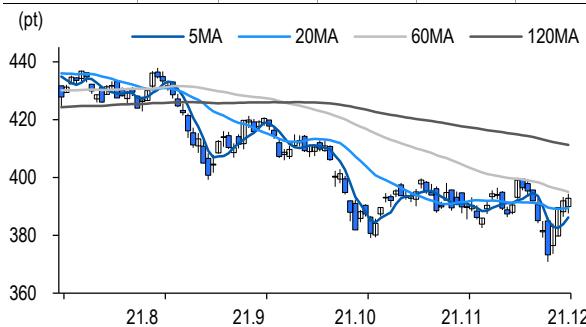


선물옵션시장 지표

2021.12.7

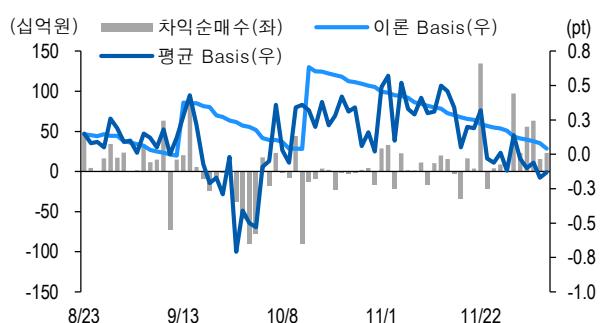
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	392.85	0.23	0.89	6,955.8	-
선물 12월물	392.30	0.01	0.05	32,381.3	234,161
선물 3월물	388.65	0.05	0.20	2,301.4	77,386
12월물(mini)	392.20	-0.02	-0.16	2,377.3	56,630
1월물(mini)	388.22	0.02	0.08	27.1	5,238



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.04	-0.13	-0.55	-0.04%
베이시스(mini)	0.04	-0.12	-0.65	-0.04%
제1스프레드(SP)	-2.74	-3.68	-3.60	-0.24%
합성선물 베이시스(ATM)	0.04	-0.60	-0.60	-0.16%



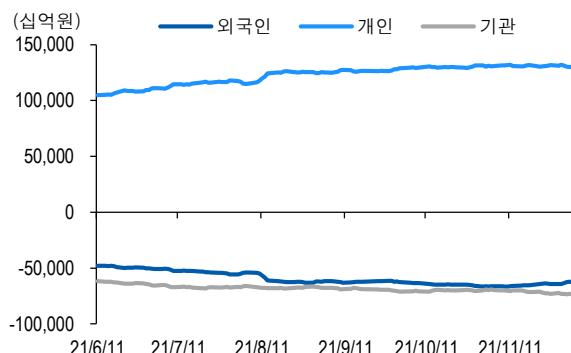
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	57.6	1.2	58.8	0.0	144.0	395.0	57.0	-4.0	-1.0	-21.0
개인	-168.5	173.2	4.7	0.0	-0.5	-46.0	-56.0	7.0	-3.0	132.0
기관	96.9	-254.3	-157.4	23.1	32.1	-360.0	0.0	-1.0	7.0	-110.0
금융투자	54.8	-197.9	-143.1	38.7	16.3	-70.0	-4.0	-2.0	6.0	-108.0
투신	13.6	-9.6	4.0	-0.3	1.7	-316.0	4.0	0.0	0.0	9.0
은행+보험+기타금융	-3.6	23.4	19.8	0.0	-5.9	13.0	0.0	0.0	1.0	-1.0
연기금+국가지자체	54.2	-67.8	-13.6	-15.3	25.0	13.0	0.0	0.0	0.0	-10.0
기타법인	14.0	79.9	93.9	0.0	-2.2	12.0	-1.0	-2.0	-3.0	-1.4

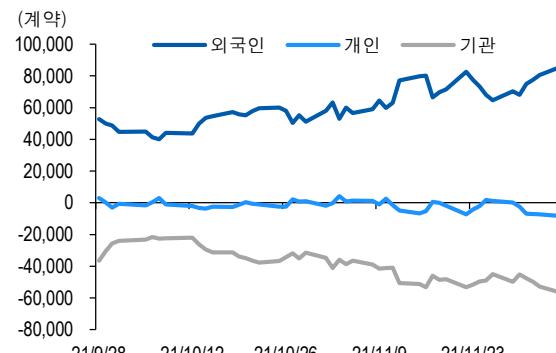
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	2,415,281	553.2	1,062,953	19.1%	지수옵션 전체	4,509,880	993.5	2,895,215							
Put	2,094,599	440.3	1,832,262	25.5%	PCR(금액기준)	0.80	VKOSPI	20.91% (+0.82%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	400.0(K+3)	0.78	-0.17	446,379	36,728	1,317	18.9	Put	395.0(K+1)	4.99	-0.27	7,829	7,262	779	23.4
	397.5(K+2)	1.38	-0.21	282,093	23,934	1,235	19.2		392.5(K+0)	3.73	-0.23	29,764	9,566	2,894	24.0
	395.0(K+1)	2.26	-0.23	224,204	20,792	245	19.4		390.0(K-1)	2.70	-0.30	66,733	22,985	3,080	24.4
	392.5(K+0)	3.48	-0.22	105,292	18,648	332	20.0		387.5(K-2)	1.92	-0.31	106,857	17,110	5,187	24.9
	390.0(K-1)	4.96	-0.30	53,450	23,604	2,935	20.2		385.0(K-3)	1.36	-0.30	173,761	23,743	3,512	25.7

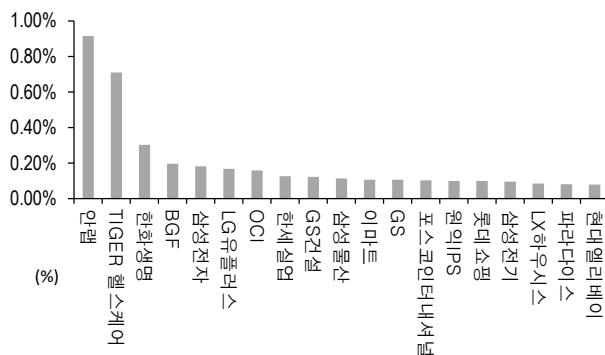
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	4,236,368	3,436.6	5,668,725	454,970	1,109	147,873	-148,244	-21.0	132.1	-109.7
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
엔씨소프트	713,000	-2.73	106.7	88.4	8,817	-851	0.07%	-563	1,143	-573
삼성전자	76,400	0.79	1,038.8	84.5	1,143,785	-81,240	0.18%	-31,899	109,015	-77,652
GS 건설	40,300	1.51	18.0	83.4	40,857	4,855	0.12%	-18	5,916	-5,898
SK 하이닉스	119,000	0.42	419.0	82.6	172,171	17,114	0.03%	-2,090	11,423	-8,706
LG 화학	716,000	-0.69	73.3	73.3	8,976	-576	0.05%	-248	-82	331
한국금융지주	82,100	1.23	10.6	69.2	17,084	-5,417	-0.33%	915	77	-992
현대차	207,000	0.73	70.0	67.6	36,850	-928	0.00%	-166	664	-446
하나금융지주	42,600	0.47	19.5	66.3	88,349	-4,092	-0.03%	1,894	-2,582	809
아모레퍼시픽	172,500	3.29	26.6	63.1	15,678	3,127	-0.65%	-401	83	318
삼성전기	179,500	0.28	73.2	61.9	30,275	2,381	0.09%	-2,168	2,610	-430

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터