

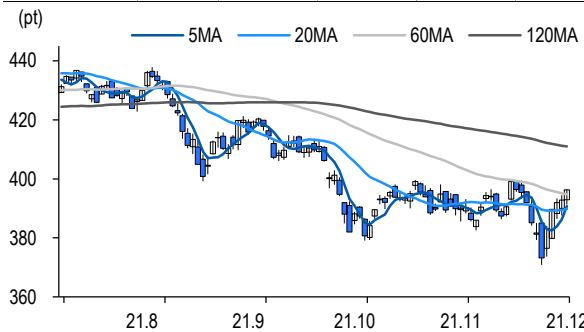


## 선물옵션시장 지표

2021.12.8

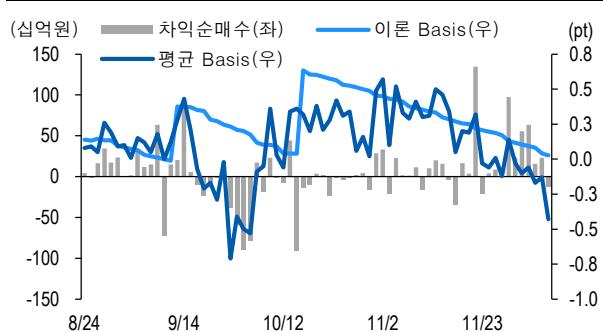
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	396.31	0.88	3.46	7,361.5	-
선물 12월물	396.15	0.98	3.85	29,601.3	182,285
선물 3월물	392.70	1.04	4.05	3,331.4	163,634
12월물(mini)	396.20	0.99	4.00	1,885.2	55,067
1월물(mini)	392.28	1.05	4.06	25.7	5,699



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.03	-0.43	-0.16	-0.12%
베이시스(mini)	0.03	-0.43	-0.11	-0.12%
제1스프레드(SP)	-2.72	-3.51	-3.60	-0.20%
합성선물 베이시스(ATM)	0.03	-0.15	-0.15	-0.04%



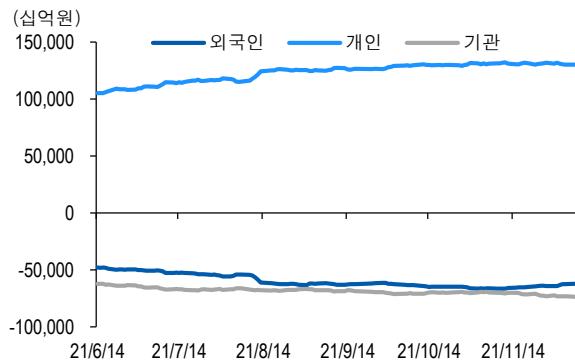
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	206.6	8.1	214.7	0.0	-13.2	-49.0	-0.3	0.2	2.7	-34.8
개인	-138.7	202.9	64.2	0.0	0.4	-12.1	-3.1	-0.8	-5.5	23.5
기관	-79.8	-231.8	-311.6	-12.2	-5.5	71.2	4.4	0.4	3.6	10.5
금융투자	-117.8	-172.3	-290.1	-6.4	4.3	110.2	4.3	-0.2	3.6	-54.9
투신	62.1	-12.9	49.2	0.0	3.1	-98.0	0.1	0.5	0.0	26.1
은행+보험+기타금융	-15.9	22.5	6.6	0.0	-6.0	56.3	0.0	0.1	0.0	-0.7
연기금+국가지자체	-70.7	-62.6	-133.2	-5.8	-6.1	2.6	0.0	0.0	0.0	40.0
기타법인	11.9	20.8	32.7	0.0	0.2	-10.1	-1.0	0.2	-0.8	0.8

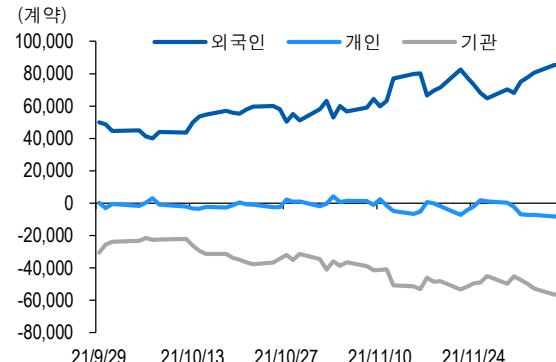
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

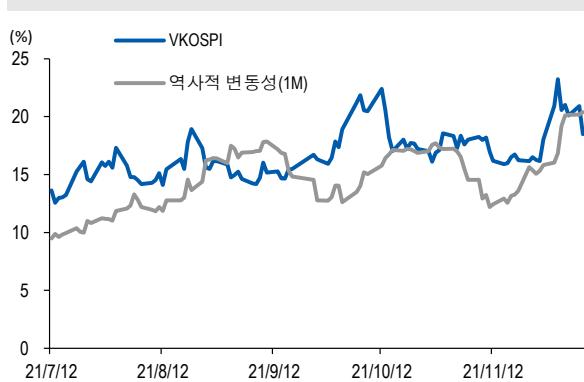
## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



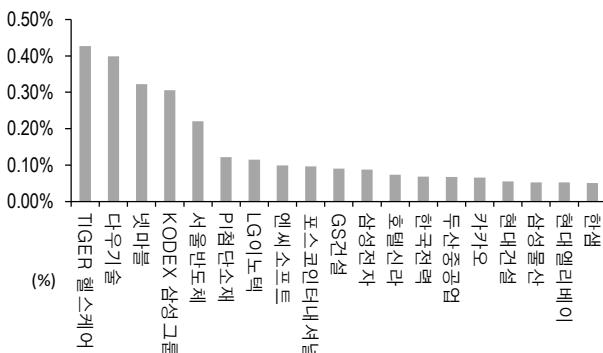
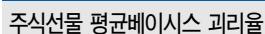
## 선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)							
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성			거래량	거래대금	미결제약정						
Call	2,202,428	474.9	1,080,869	15.3%	지수옵션 전체		4,362,338	841.3	2,969,357						
Put	2,159,910	366.5	1,888,488	19.8%	PCR(금액기준)		0.77	VKOSPI	18.48%(-2.43%p)						
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	400.0(K+3)	0.82	0.04	446,622	38,362	1,634	15.1	Put	395.0(K+1)	1.82	-3.17	43,592	11,557	4,295	17.0
	397.5(K+2)	1.68	0.30	302,897	23,494	-440	15.4		392.5(K+0)	1.09	-2.64	90,857	12,857	3,291	18.0
	395.0(K+1)	3.00	0.74	195,917	20,144	-648	15.8		390.0(K-1)	0.62	-2.08	197,678	25,426	2,441	18.8
	392.5(K+0)	4.75	1.27	72,161	18,187	-461	16.4		387.5(K-2)	0.34	-1.58	213,976	23,432	6,322	19.6
	390.0(K-1)	6.80	1.84	21,241	20,578	-3,026	16.9		385.0(K-3)	0.19	-1.17	273,326	27,000	3,257	20.6

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



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	4,745,406	3,551.8	5,985,891	317,166	-83,497	-3,069	84,813	-34.8	23.5	10.5		
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균파리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넷마블	120,000	1.27	19.8	98.9	6,021	-3,595	0.32%	-676	-43	720	-4,254	-557
삼성전자	77,500	1.44	1,034.0	74.4	1,018,058	-125,727	0.09%	-6,494	6,458	-1,650	-55,948	18,100
엔씨소프트	719,000	0.84	112.9	71.0	8,580	-237	0.10%	-10	1,109	-1,134	-646	-519
현대차	207,000	0.00	70.1	68.8	30,473	-6,377	-0.01%	-1,294	2,894	-1,600	-2,047	447
LG 화학	707,000	-1.26	75.0	62.7	6,958	-2,018	-0.16%	-240	28	212	398	698
하나금융지주	42,850	0.59	17.1	58.3	83,609	-4,740	-0.09%	-2,843	323	2,801	2,314	504
POSCO	288,500	0.70	50.4	56.8	8,920	-1,667	-0.16%	-686	-160	797	1,233	223
대한항공	29,600	1.54	32.1	56.7	82,403	8,014	0.05%	-5,325	4,238	1,087	-9,810	3,065
SK 하이닉스	122,000	2.52	334.5	54.5	155,494	-16,677	-0.09%	-336	-2,856	3,100	1,691	1,900
삼성전기	181,000	0.84	63.1	54.3	25,989	-4,286	-0.05%	-1,006	-2,900	3,945	-77	2,114

---

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터