

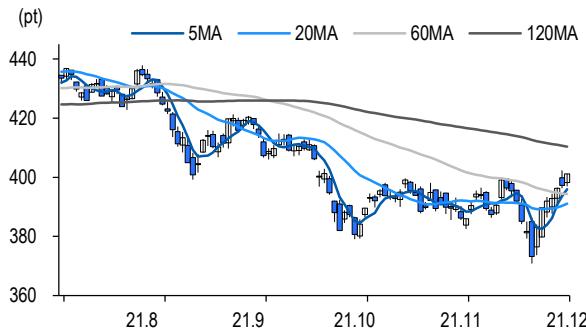


선물옵션시장 지표

2021.12.10

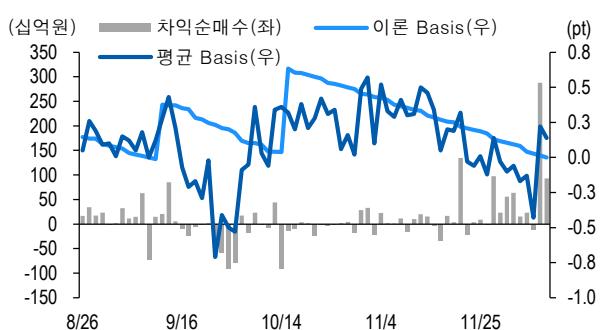
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	401.13	0.97	3.86	9,525.7	-
선물 12월물	399.40	0.29	1.15	16,273.5	0
선물 3월물	395.95	0.24	0.95	11,070.2	224,026
12월물(mini)	399.38	0.28	1.00	617.7	0
1월물(mini)	395.16	0.42	1.66	962.6	16,100



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	0.00	0.14	-1.73	0.03%
베이시스(mini)	0.00	0.14	-1.75	0.03%
제1스프레드(SP)	-2.70	-3.94	-4.35	-0.31%
합성선물 베이시스(ATM)	0.00	-1.82	-1.82	-0.45%



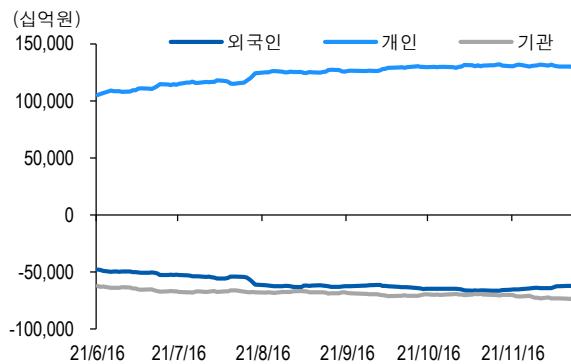
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-133.7	14.7	-119.0	-12.0	-128.4	609.4	-11.9	6.0	4.5	-12.2
개인	-509.2	86.1	-423.2	0.0	0.1	-277.5	7.9	-1.9	-7.9	45.7
기관	616.0	-107.6	508.5	105.0	843.5	-261.7	5.8	-4.1	4.0	-34.6
금융투자	966.1	-77.7	888.4	136.1	888.8	191.6	2.9	-2.6	5.0	-2.7
투신	-123.7	21.0	-102.7	0.0	-119.6	-243.5	0.3	-0.9	0.0	-7.4
은행+보험+기타금융	42.6	-48.2	-5.6	0.0	34.2	-16.4	2.5	-0.6	-1.0	-5.2
연기금+국가지자체	-260.7	-1.8	-262.4	-31.0	11.1	-193.4	0.0	0.0	0.0	-19.3
기타법인	26.9	6.8	33.7	0.0	0.1	-70.1	-1.7	0.0	-0.5	1.1

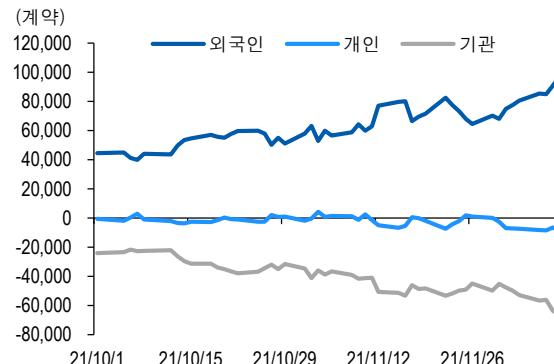
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



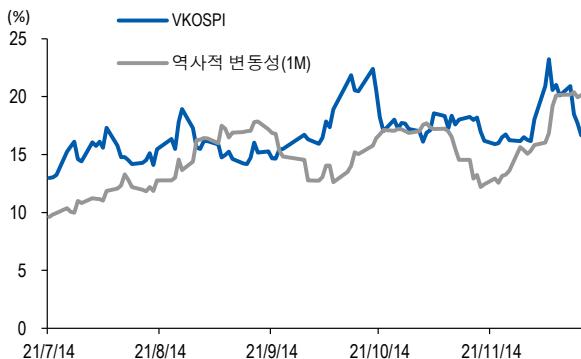
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	2,205,952	354.7	399,121	5.6%	지수옵션 전체	4,780,554	704.9	1,160,714							
Put	2,574,602	350.2	761,593	13.4%	PCR(금액기준)	0.99	VKOSPI	16.65%(-1.04%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	405.0(K+3)	0.01	-0.06	230,309	0	-48,932	8.5	Put	400.0(K+1)	0.78	-1.67	293,460	0	-20,379	15.2
	402.5(K+2)	0.01	-0.29	684,607	0	-35,920	3.5		397.5(K+0)	0.01	-1.25	695,884	0	-15,660	8.2
	400.0(K+1)	0.15	-0.70	744,668	0	-39,670	5.1		395.0(K-1)	0.01	-0.54	591,034	0	-24,904	12.9
	397.5(K+0)	1.82	-0.18	245,739	0	-23,268	6.8		392.5(K-2)	0.01	-0.22	237,931	0	-24,216	17.4
	395.0(K-1)	4.29	0.39	38,566	0	-19,176	12.0		390.0(K-3)	0.01	-0.11	101,864	0	-28,979	21.8

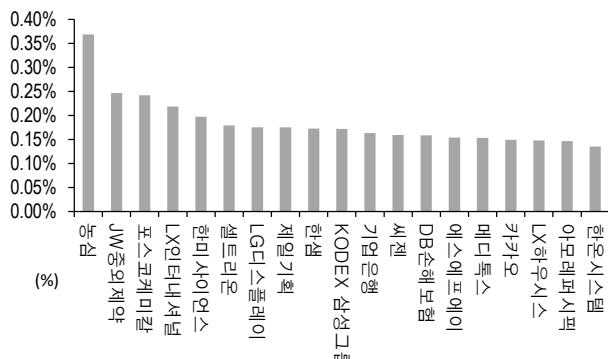
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	4,741,616	4,105.2	4,216,845	-1,726,750	10,443	21,434	-32,695	-12.2	45.7	-34.6
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
아모레퍼시픽	177,000	4.12	36.5	61.7	0	-14,857	0.15%	911	23	-934
GS건설	40,700	-0.73	9.7	55.0	0	-21,885	-0.09%	-728	2,199	-1,469
셀트리온헬스케어	83,300	2.97	47.4	52.6	0	-44,295	-0.11%	-673	3,966	-3,296
셀트리온	210,500	1.20	79.3	46.7	0	-25,651	0.18%	-654	4,126	-3,463
SK 하이닉스	122,500	1.66	311.0	45.2	0	-113,936	-0.23%	372	9,364	-9,499
삼성전자	77,600	0.00	538.8	32.1	0	-714,252	-0.08%	-3,052	35,166	-32,316
LG 디스플레이	22,000	1.38	31.6	31.7	0	-191,452	0.18%	4,965	260	-5,200
포스코인터내셔널	20,700	1.47	3.3	30.7	0	-30,604	-0.04%	-796	259	537
LG 이노텍	301,500	4.69	63.1	30.6	0	-9,342	-0.01%	-913	286	615
OCI	111,000	1.37	8.3	30.0	0	-7,031	-0.22%	1,110	-517	-596

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터