

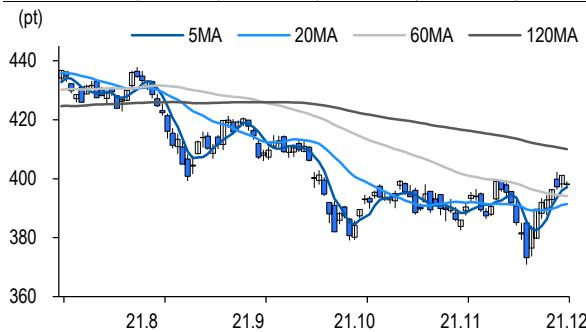


선물옵션시장 지표

2021.12.13

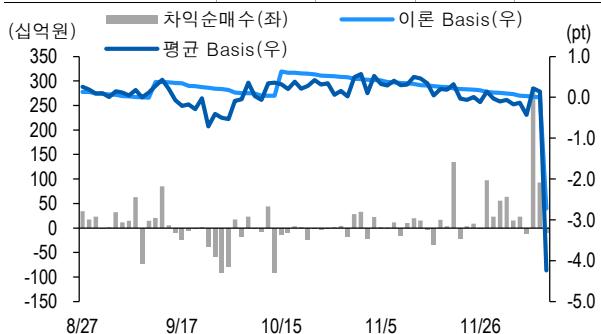
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	397.97	-0.79	-3.16	5,833.5	-
선물 3월물	393.00	-0.75	-2.95	21,451.1	226,093
선물 6월물	393.25	-0.78	-3.10	14.0	9,581
1월물(mini)	392.52	-0.67	-2.64	1,504.3	19,853
2월물(mini)	393.20	-0.70	-2.76	1.6	200



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-2.72	-4.24	-4.97	-0.38%
베이시스(mini)	-3.49	-4.80	-5.45	-0.33%
제1스프레드(SP)	0.62	0.22	0.20	-0.10%
합성선물 베이시스(ATM)	-3.49	-5.52	-5.52	-0.51%

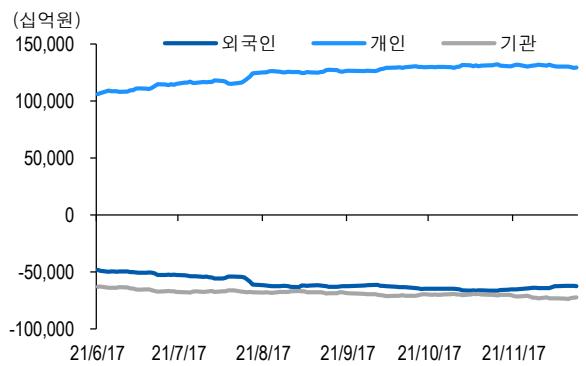


투자주체별 매매 동향 (십억원)

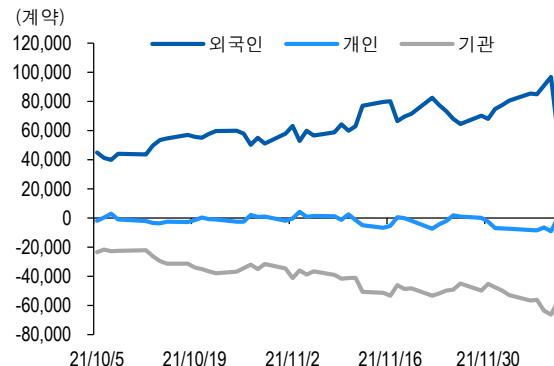
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-282.2	-52.5	-334.7	0.0	-313.1	503.6	-81.9	-0.3	-4.1	3.3
개인	120.4	34.1	154.5	0.0	-1.1	15.9	78.6	0.5	-1.6	65.3
기관	131.3	16.2	147.5	-8.5	20.3	-525.8	2.6	0.1	6.0	-68.7
금융투자	-71.2	13.2	-57.9	-0.6	5.4	-317.4	2.8	0.8	6.6	-6.7
투신	120.3	-3.7	116.6	0.0	40.1	-222.4	-0.1	-0.3	-0.5	-0.7
은행+보험+기타금융	-16.1	19.8	3.7	0.0	-22.5	7.3	-0.1	-0.5	0.0	3.7
연기금+국가지자체	104.0	-3.6	100.4	-7.9	-6.3	6.6	0.0	0.0	0.0	-65.1
기타법인	30.5	2.2	32.7	0.0	-0.1	6.3	0.6	-0.3	-0.3	0.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	391,437	151.8	443,723	13.0%	지수옵션 전체	848,932	338.4	1,271,949
Put	457,495	186.5	828,226	17.5%	PCR(금액기준)	1.23	VKOSPI	17.39% (+0.74%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	407.5(K+3)	1.93	-0.59	42,879	6,529	1,898	13.0	402.5(K+1)
	405.0(K+2)	2.53	-0.66	30,996	12,232	2,037	13.1	400.0(K+0)
	402.5(K+1)	3.24	-0.82	21,873	6,706	1,307	13.2	397.5(K-1)
	400.0(K+0)	4.10	-0.96	13,587	11,175	994	13.2	395.0(K-2)
	397.5(K-1)	5.11	-1.11	5,878	3,667	337	13.3	392.5(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	402.5(K+1)	12.85	1.55	163	239	61	16.8	400.0(K+0)
	400.0(K+0)	11.65	1.86	832	4,468	143	17.6	397.5(K-1)
	397.5(K-1)	10.10	1.80	952	1,111	261	17.4	395.0(K-2)
	395.0(K-2)	8.76	1.49	1,837	2,865	209	17.5	392.5(K-3)
	392.5(K-3)	7.57	1.37	2,244	1,917	161	17.6	

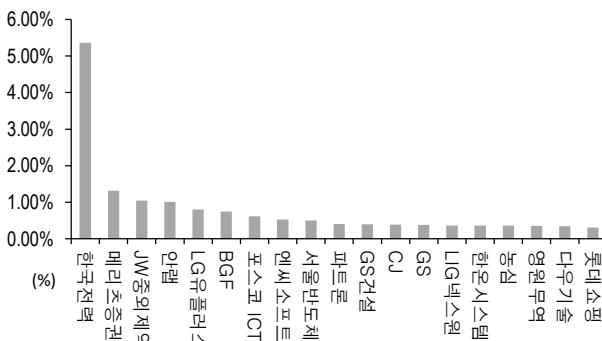
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,102,798	1,669.0	4,440,928	224,083	-10,187	99,414	-89,691	3.3	65.3	-68.7
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
LG 이노텍	304,500	1.16	107.8	88.1	11,292	2,040	-0.03%	-1,949	-104	1,833
대한항공	29,550	-0.51	18.2	83.2	88,511	9,457	0.08%	1,714	3,619	-5,333
호텔신라	76,800	-1.54	20.1	81.9	14,094	6,079	-0.30%	1,656	-157	-1,498
삼성전자	76,300	-1.80	479.4	68.1	1,378,656	10,771	-0.38%	16,458	2,769	-18,792
현대차	205,000	0.00	59.5	64.7	41,863	5,887	-0.05%	-735	5,545	-4,911
GS 건설	40,050	0.50	6.3	60.7	42,221	1,063	0.40%	421	1,311	-1,732
한국전력	22,250	-0.67	9.8	54.5	159,808	1,507	5.36%	-14,014	2,264	11,703
한국조선해양	99,000	0.51	4.5	51.5	2,803	910	-0.08%	404	86	-490
한국금융지주	79,000	-0.38	4.1	48.7	23,048	696	-1.12%	382	290	-672
한국항공우주	29,300	-1.51	3.9	44.3	7,551	-432	-0.25%	-1,513	234	1,279

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터