

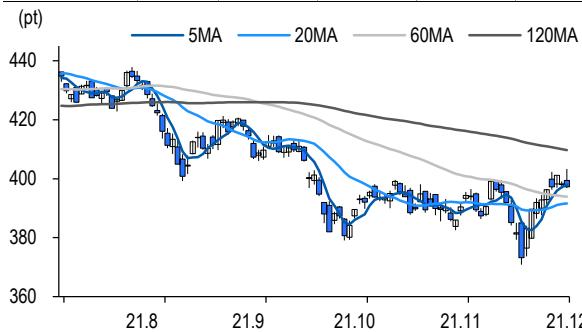


선물옵션시장 지표

2021.12.14

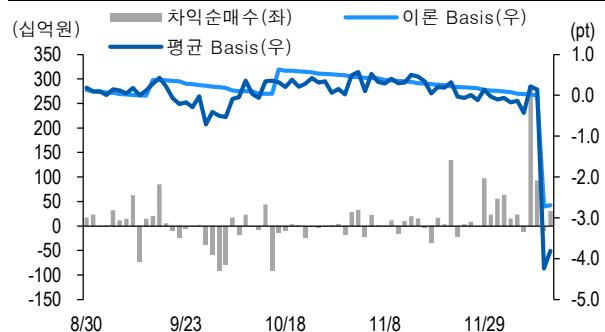
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	397.27	-0.18	-0.70	6,765.7	-
선물 3월물	393.90	0.23	0.90	24,408.7	233,538
선물 6월물	394.15	0.23	0.90	19.9	9,588
1월물(mini)	393.22	0.18	0.70	2,039.1	26,081
2월물(mini)	393.20	0.00	0.00	6.5	412



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-2.69	-3.81	-3.37	-0.28%
베이시스(mini)	-3.45	-4.43	-4.05	-0.25%
제1스프레드(SP)	0.63	0.17	0.15	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	-3.45	-3.98	-3.98	-0.13%



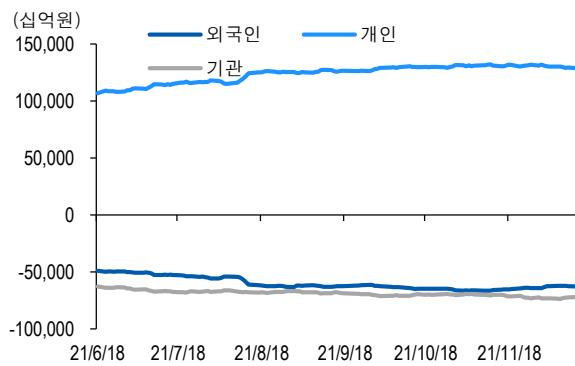
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-137.3	8.6	-128.7	0.0	-142.4	73.0	-36.1	-2.7	-5.6	-0.9
개인	-365.9	19.7	-346.2	0.0	-2.1	102.2	49.5	2.6	0.1	46.1
기관	468.8	-27.1	441.7	30.3	-6.3	-163.1	-12.5	0.3	5.8	-44.8
금융투자	386.4	-15.3	371.1	4.2	13.8	-118.6	-12.5	-1.8	6.0	-36.7
투신	53.1	-3.4	49.7	6.0	-4.3	9.1	0.0	-0.4	-0.1	43.9
은행+보험+기타금융	-8.5	-3.2	-11.7	0.0	-18.6	-32.4	0.0	2.6	-0.2	-4.6
연기금+국가지자체	74.4	-10.2	64.2	20.1	13.6	-21.1	0.0	0.0	0.0	-47.5
기타법인	34.4	-1.2	33.2	0.0	-0.1	-12.2	-0.9	-0.2	-0.2	-0.4

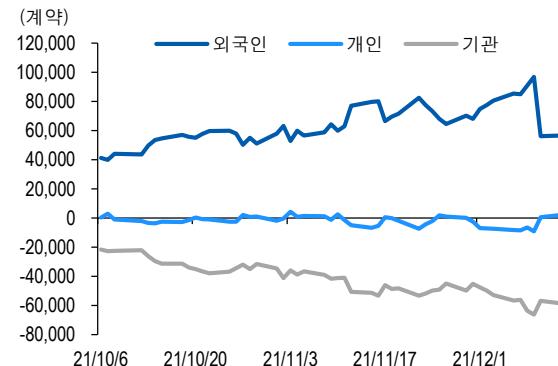
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	652,861	252.5	486,073	14.5%	지수옵션 전체		1,296,864	504.3	1,362,095		
Put	644,003	251.8	876,022	16.8%	PCR(금액기준)		1.00	VKOSPI	18.00% (+0.61%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	405.0(K+3)	2.66	0.13	36,971	12,757	525	14.5	400.0(K+1)	11.00	-0.65	1,005
	402.5(K+2)	3.41	0.17	21,693	7,098	392	14.7	397.5(K+0)	9.55	-0.55	3,710
	400.0(K+1)	4.30	0.20	15,849	12,081	906	14.8	395.0(K-1)	8.23	-0.53	8,392
	397.5(K+0)	5.34	0.23	6,635	3,851	184	15.0	392.5(K-2)	7.09	-0.48	5,213
	395.0(K-1)	6.54	0.29	3,801	4,392	316	15.3	390.0(K-3)	6.06	-0.46	8,587
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	400.0(K+1)	11.00	-0.65	1,005	4,691	223	16.1	397.5(K+0)	9.55	-0.55	3,710
	397.5(K+0)	8.23	-0.53	8,392	3,302	437	16.4	395.0(K-1)	7.09	-0.48	5,213
	395.0(K-1)	7.09	-0.48	5,213	2,272	355	16.7	392.5(K-2)	6.06	-0.46	8,587
	392.5(K-2)	6.06	-0.46	8,587	4,934	521	16.9	390.0(K-3)	5.54	-0.44	8,587
	390.0(K-3)	5.54	-0.44	8,587	4,934	521	16.9				

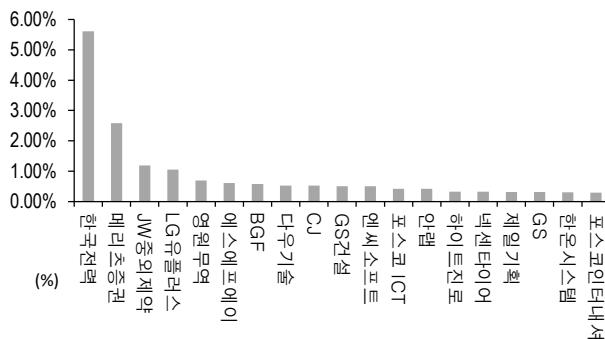
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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)	금융투자	연기금등	
주식선물 전체	3,058,151	2,571.6	4,719,506	278,578	18,223	27,310	-45,910	-0.9	46.1	-44.8	26	-1,211	
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수	
LG 이노텍	313,000	2.79	106.1	81.4	13,126	1,834	-0.02%	860	-1,664	804	26	-1,211	
대한항공	29,250	-1.02	32.6	75.9	114,903	26,392	0.08%	411	277	-688	-7,808	-17,085	
삼성전자	76,600	0.39	871.1	75.5	1,418,887	40,231	-0.22%	15,336	20,894	-36,425	16,707	-41,056	
SK 하이닉스	120,500	0.42	228.4	63.4	147,076	21,328	0.11%	-2,743	5,104	-2,490	-8,400	-1,790	
현대차	206,000	0.49	117.7	63.3	53,646	11,783	-0.01%	64	11,255	-11,324	-9,041	-2,283	
엔씨소프트	712,000	-2.06	55.1	51.5	13,979	1,513	0.50%	116	1,518	-1,564	-572	308	
LG 전자	133,000	6.40	175.3	50.4	43,777	19,860	0.10%	745	-6,931	5,955	-6,744	-4,508	
호텔신라	76,600	-0.26	7.1	50.4	15,403	1,309	-0.57%	387	17	-404	1,425	380	
대한유화	196,000	-0.51	3.7	49.0	3,307	497	-1.61%	83	-465	452	310	142	
삼성 SDI	703,000	-0.57	53.6	47.5	29,841	183	0.01%	-176	479	-303	-254	501	

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터