

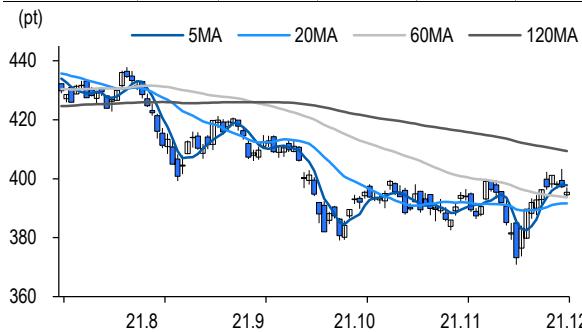


선물옵션시장 지표

2021.12.15

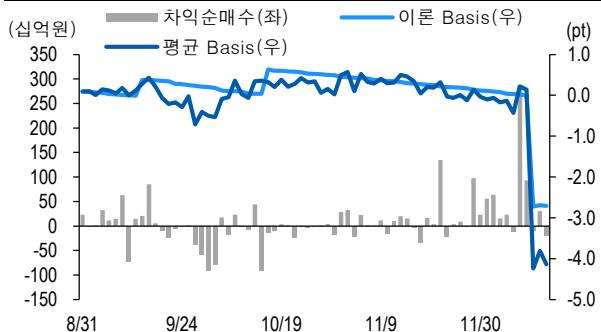
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	395.41	-0.47	-1.86	6,272.1	-
선물 3월물	390.45	-0.88	-3.45	26,519.9	231,631
선물 6월물	391.10	-0.77	-3.05	14.2	9,607
1월물(mini)	390.00	-0.82	-3.22	1,783.3	26,481
2월물(mini)	390.02	-0.81	-3.18	2.0	397



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-2.71	-4.14	-4.96	-0.36%
베이시스(mini)	-3.47	-4.73	-5.41	-0.32%
제1스프레드(SP)	0.63	0.18	0.20	-0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	-3.47	-5.19	-5.19	-0.44%



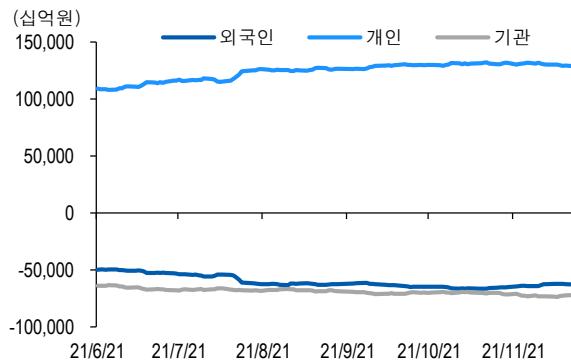
투자주체별 매매 동향

(십억원)

	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-358.9	-25.8	-384.7	0.0	-315.9	-262.0	24.7	-0.5	-3.6	-5.5
개인	513.7	65.3	579.0	0.0	-1.8	84.8	-34.6	-0.6	-1.8	51.7
기관	-199.6	-39.2	-238.7	-19.3	65.1	172.0	6.4	0.9	5.0	-45.5
금융투자	-170.8	-74.7	-245.5	-3.5	10.0	431.0	6.7	-0.1	4.7	-58.8
투신	-19.3	1.1	-18.2	0.0	23.0	-335.0	0.0	-0.1	0.1	1.3
은행+보험+기타금융	-22.9	38.4	15.5	0.0	-16.2	54.8	-0.3	1.2	0.2	-0.1
연기금+국가지자체	84.1	-0.9	83.2	-15.7	48.9	21.2	0.0	0.0	0.0	12.0
기타법인	44.8	-0.2	44.5	0.0	0.0	5.2	3.4	0.2	0.4	-0.6

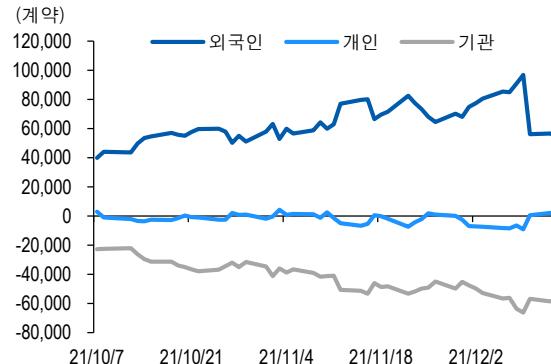
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	528,820	197.7	515,726	13.9%	지수옵션 전체	1,173,186	498.4	1,412,146
Put	644,366	300.8	896,420	18.6%	PCR(금액기준)	1.52	VKOSPI	18.40%(+0.40%p)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	405.0(K+3)	1.90	-0.76	62,702	15,958	3,201	13.9	400.0(K+1)
	402.5(K+2)	2.49	-0.92	41,193	8,400	1,302	13.9	397.5(K+0)
	400.0(K+1)	3.20	-1.10	41,306	13,879	1,798	14.0	395.0(K-1)
	397.5(K+0)	4.07	-1.27	13,177	4,822	971	14.1	392.5(K-2)
	395.0(K-1)	5.06	-1.48	6,801	4,785	393	14.2	390.0(K-3)
<hr/>								
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Put	400.0(K+1)	12.90	1.90	439	4,714	23	18.0	
	397.5(K+0)	11.35	1.80	477	1,613	-41	18.1	
	395.0(K-1)	10.15	1.92	2,996	3,521	219	18.7	
	392.5(K-2)	8.75	1.66	4,914	2,544	272	18.6	
	390.0(K-3)	7.49	1.43	5,479	5,753	819	18.6	

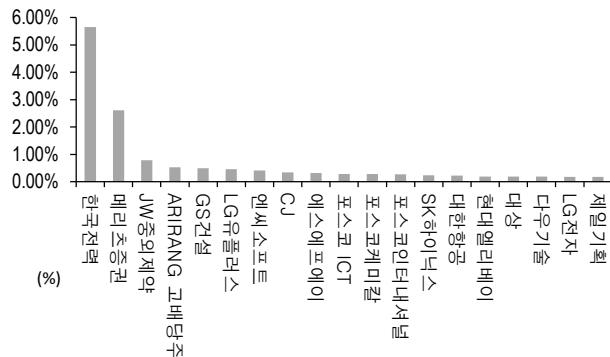
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

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	2,973,739	2,419.2	4,754,868	35,362	-25,108	65,399	-40,238	-5.5	51.7	-45.5
<hr/>										
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
삼성전자	76,200	-0.52	807.0	96.2	1,414,292	-4,595	-0.24%	-14,671	7,352	7,510
SK 하이닉스	120,000	-0.41	226.4	85.5	161,971	14,895	0.23%	1,491	10,420	-11,767
현대차	208,000	0.97	85.5	81.6	55,570	1,924	-0.02%	-798	499	299
LG 이노텍	302,000	-3.51	108.2	74.4	14,161	1,035	0.07%	-467	1,938	-1,472
대한항공	29,100	-0.51	25.2	71.7	130,819	15,916	0.23%	359	-817	458
현대제철	41,700	0.00	9.6	71.7	10,956	2,395	-0.34%	-179	-296	475
NAVER	391,000	0.00	83.7	67.2	34,496	273	-0.07%	621	488	-1,074
호텔신라	75,800	-1.04	7.9	64.3	15,866	463	-0.48%	-145	-268	425
만도	58,000	-0.85	5.0	59.5	3,301	151	-0.95%	150	19	-200
삼성전기	177,000	-1.94	32.7	57.3	26,021	-1,326	-0.18%	-1,527	-627	2,149

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터