

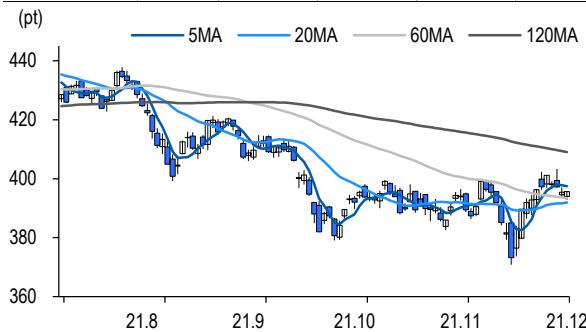


## 선물옵션시장 지표

2021.12.16

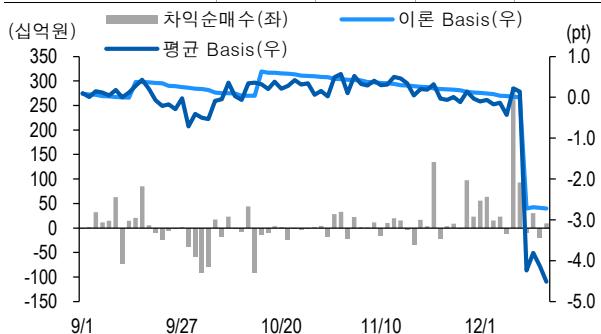
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	395.66	0.06	0.25	5,524.0	-
선물 3월물	390.85	0.10	0.40	18,952.6	231,981
선물 6월물	391.05	-0.01	-0.05	12.0	9,615
1월물(mini)	390.36	0.09	0.36	1,538.7	31,706
2월물(mini)	390.76	0.19	0.74	1.8	866



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-2.72	-4.51	-4.81	-0.45%
베이시스(mini)	-3.48	-5.01	-5.30	-0.39%
제1스프레드(SP)	0.62	0.15	0.15	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	-3.48	-5.32	-5.32	-0.46%



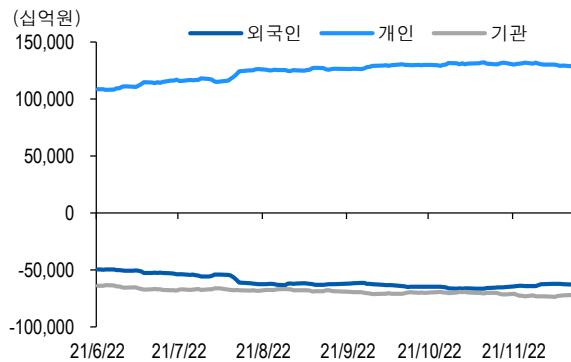
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

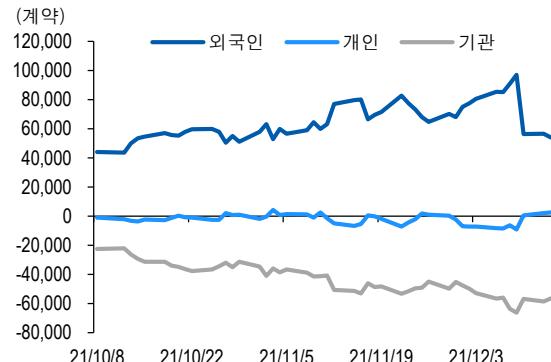
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-358.9	-25.8	-384.7	0.0	-315.9	-262.0	24.7	-0.5	-3.6	-5.5
개인	513.7	65.3	579.0	0.0	-1.8	84.8	-34.6	-0.6	-1.8	51.7
기관	-199.6	-39.2	-238.7	-19.3	65.1	172.0	6.4	0.9	5.0	-45.5
금융투자	-170.8	-74.7	-245.5	-3.5	10.0	431.0	6.7	-0.1	4.7	-58.8
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



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

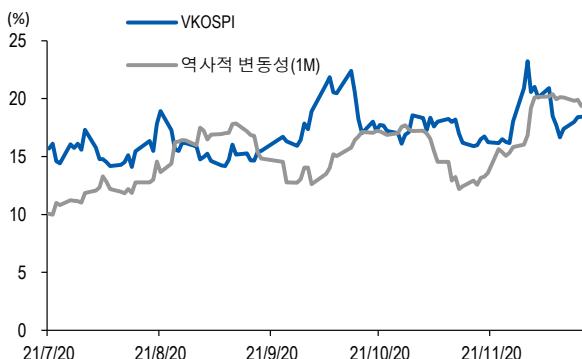
## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정							
Call	408,864	155.8	543,195	14.2%	지수옵션 전체	816,878	338.2	1,477,082							
Put	408,014	182.4	933,887	18.7%	PCR(금액기준)	1.17	VKOSPI	18.43%(+0.03%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	402.5(K+3)	2.55	0.06	37,718	9,808	1,408	14.2	Put	397.5(K+1)	11.25	-0.10	138	1,656	43	18.5
	400.0(K+2)	3.26	0.06	31,908	15,710	1,831	14.2		395.0(K+0)	9.80	-0.35	737	3,477	-44	18.5
	397.5(K+1)	4.13	0.06	14,989	5,384	562	14.3		392.5(K-1)	8.49	-0.26	3,482	3,379	835	18.6
	395.0(K+0)	5.14	0.08	6,617	5,690	905	14.3		390.0(K-2)	7.30	-0.19	5,525	6,768	1,015	18.7
	392.5(K-1)	6.29	0.11	6,026	4,775	2,285	14.4		387.5(K-3)	6.22	-0.20	5,451	4,291	1,669	18.8

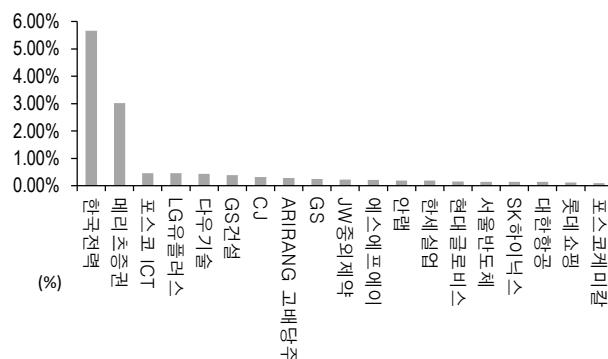
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 역사적 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	2,284,077	2,070.5	4,842,854	87,986	-35,067	63,010	-29,007	-18.2	25.9	-9.1
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수
삼성전기	180,000	1.69	56.3	86.0	32,504	6,483	0.03%	-1,097	1,216	-125
LG 이노텍	332,000	9.93	192.0	81.0	16,996	2,835	0.01%	1,596	-4,267	2,684
삼성전자	76,800	0.79	566.6	78.2	1,429,650	15,358	-0.25%	-7,109	19,988	-13,130
SK 하이닉스	123,000	2.50	249.8	76.3	176,554	14,583	0.14%	201	51	-982
현대제철	42,050	0.84	13.3	72.8	15,194	4,238	-0.39%	-2,473	-166	2,639
대한항공	29,100	0.00	16.1	68.4	131,001	182	0.14%	-3,773	1,286	2,487
현대차	206,500	-0.72	53.6	58.8	55,842	272	-0.05%	-2,576	1,618	958
삼성 SDI	674,000	-0.74	126.3	58.3	31,222	1,227	-0.09%	977	-669	-301
CJ	83,600	-0.48	1.9	55.5	7,984	328	0.31%	-40	168	-128
KB 금융	54,900	-0.18	18.5	53.4	32,565	-848	-0.79%	-317	124	193

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터