

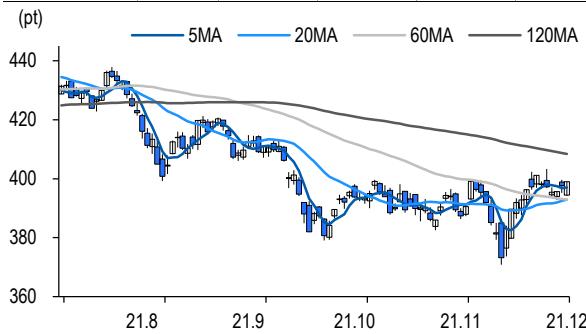


## 선물옵션시장 지표

2021.12.20

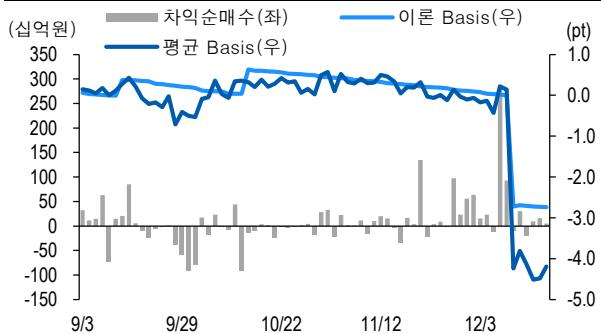
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	398.96	0.32	1.28	8,381.1	-
선물 3월물	393.95	0.11	0.45	23,081.0	229,287
선물 6월물	394.00	0.15	0.60	12.8	9,674
1월물(mini)	393.44	0.12	0.46	1,744.6	34,546
2월물(mini)	394.00	0.15	0.60	4.3	1,041



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-2.74	-4.19	-5.01	-0.36%
베이시스(mini)	-3.51	-4.77	-5.52	-0.32%
제1스프레드(SP)	0.64	0.21	0.20	-0.11%
합성선물 베이시스(ATM)	-3.51	-5.57	-5.57	-0.52%



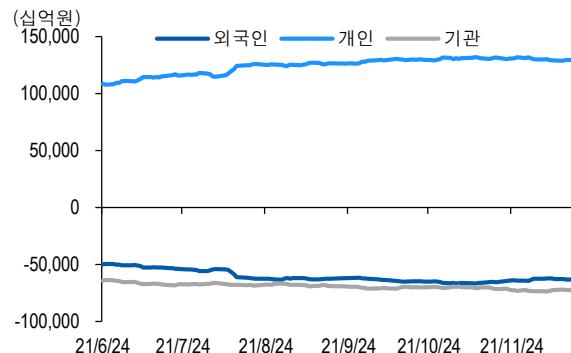
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

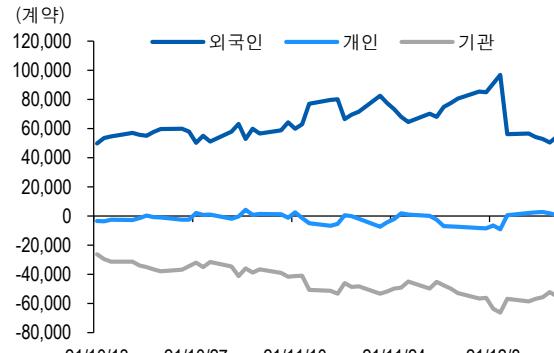
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	531.5	-140.5	390.9	3.1	424.3	465.6	-71.2	-0.4	-1.6	39.5
개인	-527.0	238.3	-288.7	0.0	0.0	-143.6	26.9	0.6	0.0	32.9
기관	-13.7	-100.3	-114.0	2.2	3.1	-317.7	47.8	-0.3	2.3	-71.1
금융투자	141.2	-136.7	4.5	2.4	-3.6	-456.1	47.8	-0.1	2.4	-67.6
투신	-24.0	-6.3	-30.4	0.0	1.4	146.0	0.1	-0.1	0.0	-2.5
은행+보험+기타금융	-16.8	17.7	0.9	0.0	-17.1	-7.1	-0.1	0.0	-0.1	-0.2
연기금+국가지자체	-5.4	18.0	12.6	-0.2	32.3	-0.6	0.0	0.0	0.0	-0.8
기타법인	9.2	2.5	11.7	0.0	0.6	-4.2	-3.4	0.0	-0.6	-1.3

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 선물옵션시장 지표

### 지수옵션 시장동향

								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	618,341	234.3	578,971	12.7%	지수옵션 전체		1,185,016	426.4	1,613,863		
Put	566,675	192.1	1,034,892	17.7%	PCR(금액기준)		0.82	VKOSPI	17.02% (+0.04%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	Put	행사가	종가	등락(pt)
	405.0(K+3)	2.10	-0.06	73,011	20,169	2,258	12.7		400.0(K+1)	10.20	-0.60
	402.5(K+2)	2.80	0.00	92,848	10,671	1,023	12.8		397.5(K+0)	8.71	-0.52
	400.0(K+1)	3.64	0.04	36,491	15,937	731	12.8		395.0(K-1)	7.43	-0.35
	397.5(K+0)	4.60	0.01	13,588	6,560	659	12.7		392.5(K-2)	6.25	-0.31
	395.0(K-1)	5.77	0.07	7,392	6,412	888	12.7		390.0(K-3)	5.24	-0.27

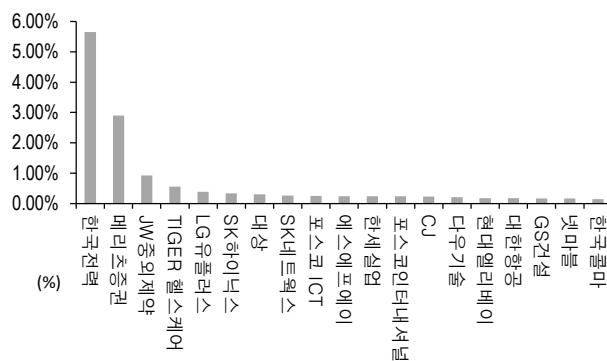
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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)
주식선물 전체	2,398,244	2,063.4	4,994,378	76,940	99,255	29,803	-127,840	39.5	32.9	-71.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	326,000	-1.95	131.9	91.7	17,009	-36	0.03%	10	4,220	-4,238	-2,620	-1,377
SK 하이닉스	121,500	-1.62	306.8	68.1	215,264	15,314	0.33%	11,473	6,135	-17,608	-16,979	140
삼성전자	77,300	0.00	538.5	58.8	1,414,194	-17,411	-0.30%	-7,677	-14,666	22,781	5,916	21,349
SK 이노베이션	230,000	1.55	89.4	54.0	25,217	4,078	-0.51%	-2,637	922	1,682	-3,268	319
현대차	208,000	0.48	70.0	54.0	59,075	2,437	0.02%	2,291	2,042	-4,333	-1,638	-2,695
현대제철	43,750	3.55	19.4	45.4	27,718	9,971	-0.31%	1,861	1,382	-3,268	-9,522	-1,637
호텔신라	76,400	1.06	5.6	45.4	20,580	345	-0.40%	760	206	-966	217	-1,183
대한항공	29,300	1.03	15.0	45.3	139,608	11,590	0.17%	11,490	-2,004	-9,486	-9,115	-4,226
POSCO	282,000	2.92	63.6	44.2	28,469	2,802	-1.88%	92	851	-947	-2,818	425
LG 전자	128,500	-0.77	51.7	42.6	42,598	360	0.10%	348	1,177	-1,475	-3,980	2,505

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터