

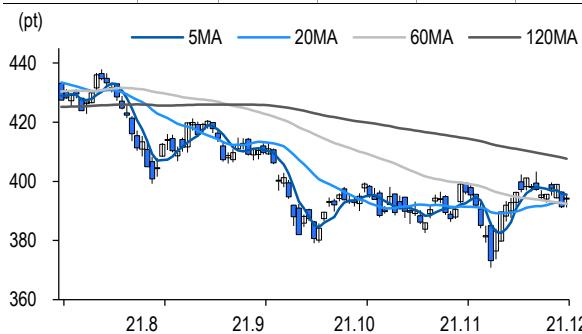


## 선물옵션시장 지표

2021.12.22

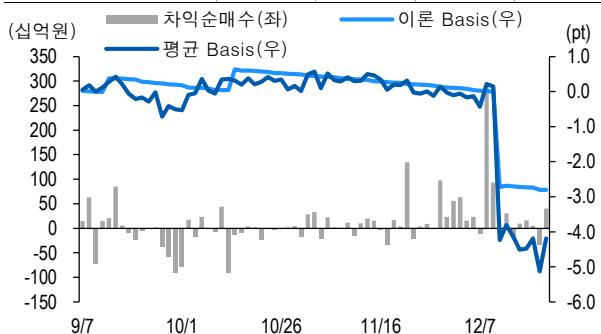
## Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	393.95	0.66	2.58	6,345.3	-
선물 3월물	389.50	0.75	2.90	23,049.8	232,491
선물 6월물	389.60	0.75	2.90	19.5	9,970
1월물(mini)	388.90	0.70	2.72	2,246.0	44,477
2월물(mini)	389.10	0.69	2.66	2.7	631



## 차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	-2.81	-4.19	-4.45	-0.35%
베이시스(mini)	-3.57	-4.82	-5.05	-0.32%
제1스프레드(SP)	0.62	0.13	0.15	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	-3.57	-4.99	-4.99	-0.36%



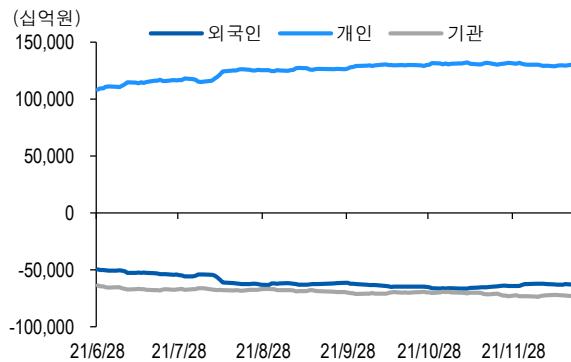
## 투자주체별 매매 동향

(십억원)

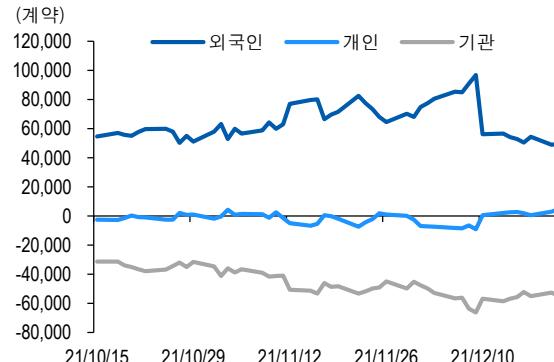
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	32.4	24.0	56.4	0.0	69.0	212.1	-154.3	-2.9	-1.0	36.4
개인	-649.2	-24.9	-674.1	0.0	1.3	148.3	23.8	0.9	-0.4	-35.1
기관	599.2	6.5	605.7	40.4	-11.8	-356.5	130.1	2.1	1.4	-2.0
금융투자	585.3	20.2	605.4	12.9	14.9	-619.0	130.1	2.0	1.0	13.0
투신	-7.7	-3.9	-11.6	0.0	-6.9	301.4	0.0	0.0	0.1	48.6
은행+보험+기타금융	-25.3	14.4	-11.0	0.0	-6.2	-1.0	0.0	0.0	0.4	0.2
연기금+국가지자체	23.0	-8.4	14.6	27.6	-22.1	-37.9	0.0	0.0	0.0	-63.9
기타법인	17.6	-5.7	11.9	0.0	0.4	-3.9	0.4	-0.1	0.0	0.7

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	551,726	194.6	638,252	14.2%	지수옵션 전체	1,120,243	407.9	1,712,178							
Put	568,517	213.3	1,073,926	18.3%	PCR(금액기준)	1.10	VKOSPI	18.32%(-1.20%p)							
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성								
Call	400.0(K+3)	2.20	0.34	68,564	21,127	2,894	14.3	Put	395.0(K+1)	9.77	-2.23	695	3,297	-120	18.0
	397.5(K+2)	2.89	0.43	39,583	8,301	1,096	14.3		392.5(K+0)	8.30	-2.15	1,328	4,576	-151	18.0
	395.0(K+1)	3.74	0.57	25,427	8,475	136	14.3		390.0(K-1)	7.01	-1.93	4,637	8,290	-514	18.1
	392.5(K+0)	4.76	0.72	7,902	6,159	302	14.4		387.5(K-2)	5.89	-1.78	4,310	5,292	325	18.2
	390.0(K-1)	5.99	0.88	5,560	5,710	111	14.5		385.0(K-3)	4.94	-1.62	9,639	8,712	-174	18.5

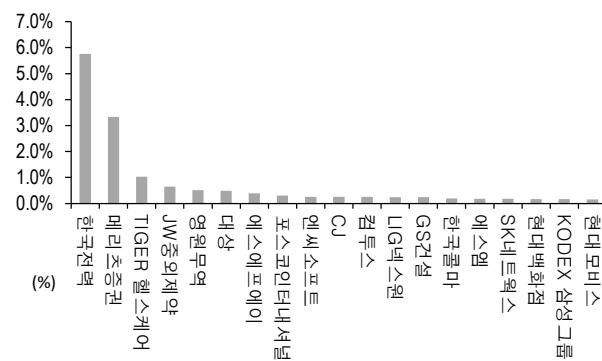
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

### 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	3,080,011	2,590.6	5,122,661	173,504	5,861	-54,570	49,020	36.4	-35.1	-2.0
종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수
LG 이노텍	335,500	6.17	204.5	92.7	14,943	1,965	0.04%	762	-3,152	2,405
현대제철	42,000	0.12	13.2	88.8	30,040	-1,593	-0.35%	-3,154	-568	3,772
하나투어	71,400	4.54	5.6	87.5	7,691	203	-0.73%	572	-587	15
호텔신라	75,400	1.07	12.1	78.2	19,244	-1,148	-0.40%	-277	247	30
삼성전자	77,400	1.31	786.4	75.5	1,469,062	69,214	-0.22%	10,035	1,448	-11,663
삼성전기	177,000	2.61	55.2	74.8	23,930	-54	-0.49%	2,261	-4,224	1,963
대한항공	29,000	1.05	18.7	73.3	153,872	11,745	0.10%	1,026	-1,900	874
현대차	201,500	-0.25	76.9	68.3	59,127	104	0.02%	248	-376	128
SK 이노베이션	214,000	-0.93	48.1	64.8	19,142	110	-1.04%	-79	-135	194
LG 전자	129,000	3.61	74.3	58.0	30,011	750	-0.17%	2,725	2,507	-5,112

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터