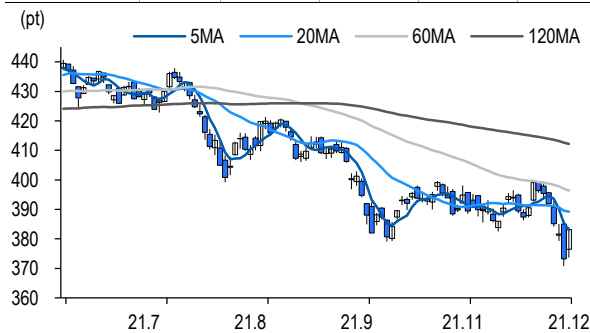


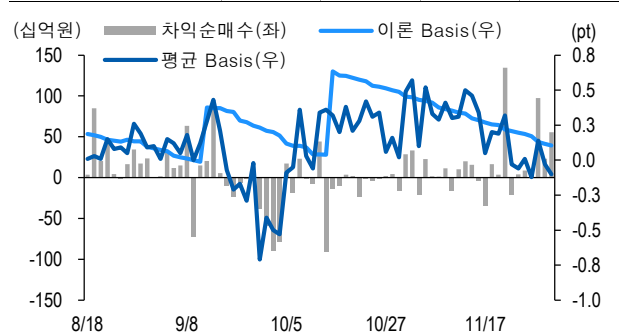
## 선물옵션시장 지표

2021.12.2

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	383.13	2.65	9.89	9,574.9	-
선물 12월물	383.00	2.58	9.65	37,528.2	287,641
선물 3월물	379.40	2.73	10.10	327.8	15,405
12월물(mini)	382.98	2.58	9.76	2,399.9	52,914
1월물(mini)	378.92	2.60	9.60	11.9	1,509



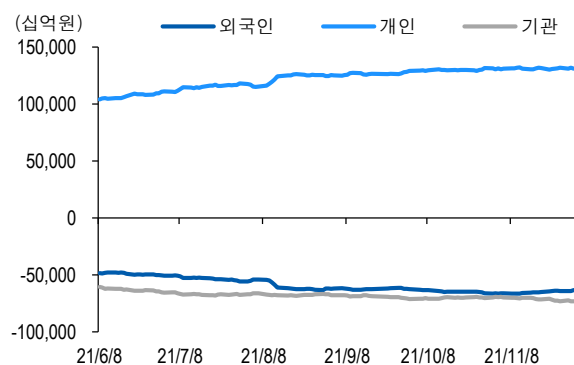
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.11	-0.10	-0.13	-0.05%
베이스(mini)	0.11	-0.10	-0.15	-0.05%
제1스프레드(SP)	-2.77	-3.90	-3.90	-0.30%
합성선물 베이스(ATM)	0.11	0.05	0.05	-0.01%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	906.7	16.0	922.7	-1.2	660.7	495.9	148.5	4.0	-6.2	-39.4
개인	-994.3	164.2	-830.1	0.0	0.0	-294.4	-134.1	-1.5	1.5	-2.3
기관	89.5	-183.7	-94.2	56.9	51.0	-215.9	-3.3	-2.8	4.6	44.3
금융투자	-136.5	-279.3	-415.7	36.1	11.0	-856.8	-3.9	-1.9	3.7	0.0
투신	80.3	19.2	99.5	0.0	8.1	646.2	0.5	0.1	0.0	85.8
은행+보험+기타금융	9.7	82.0	91.7	0.0	2.3	15.1	0.1	-1.0	0.9	-0.4
연기금+국가자재	123.3	-0.1	123.2	20.8	28.7	-20.5	0.0	0.0	0.0	-41.2
기타법인	-1.8	3.4	1.6	0.0	-0.3	14.4	-11.1	0.3	0.1	-2.6

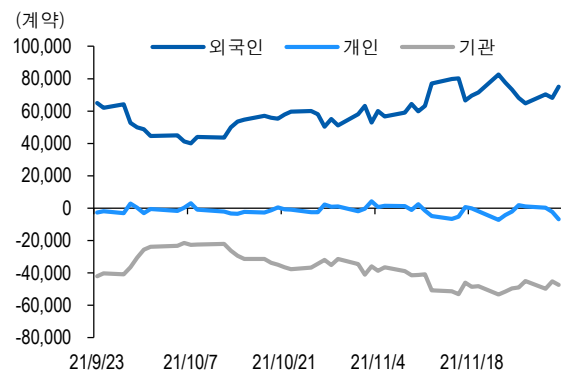
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

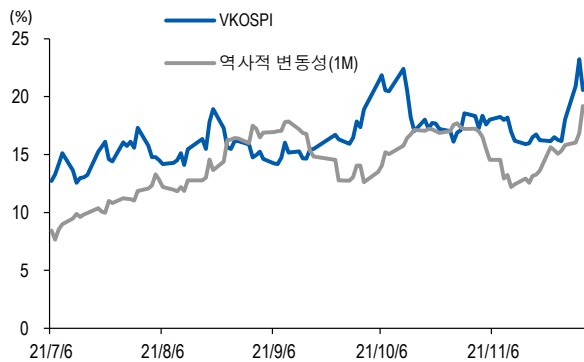
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,564,966	486.7	972,914	18.7%	지수옵션 전체	2,990,123	855.1	2,588,883
Put	1,425,157	368.4	1,615,969	23.2%	PCR(금액기준)	0.76	VKOSPI	20.57%(-2.66%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	380.0(K+3)	6.31	3.44	62,849	9,760	1,219	18.8	Put	375.0(K+1)	1.96	-4.54	40,548	20,203	231	21.3
	377.5(K+2)	8.06	4.27	15,417	3,181	95	19.4		372.5(K+0)	1.52	-3.99	39,942	18,302	50	22.1
	375.0(K+1)	9.98	4.90	9,272	2,438	213	20.1		370.0(K-1)	1.16	-3.43	95,193	29,237	-812	22.8
	372.5(K+0)	12.20	5.73	2,542	1,048	249	21.7		367.5(K-2)	0.91	-2.89	67,778	18,719	393	23.7
	370.0(K-1)	14.30	6.39	2,165	3,541	27	22.1		365.0(K-3)	0.69	-2.42	110,545	22,558	480	24.4

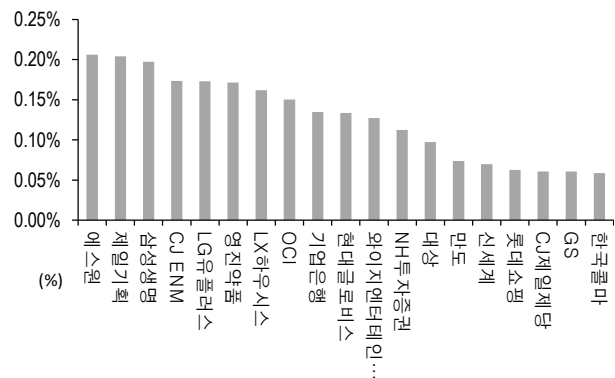
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 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	4,789,499	3,960.7	5,059,472	71,022	-56,777	26,331	33,206	-39.4	-2.3	44.3			

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
엔씨소프트	705,000	3.37	178.8	88.5	9,482	-387	0.05%	-13	-73	86	-165	-259
삼성전자	74,200	3.78	1,265.1	78.7	1,159,957	40,097	0.02%	-26,653	-12,082	38,029	-16,101	-10,962
GS 건설	37,650	1.76	13.2	75.7	35,787	3,558	-0.13%	-2,817	2,087	730	6,433	344
LG 화학	721,000	2.85	130.5	75.7	8,512	-91	0.03%	12	-133	121	42	-315
SK 하이닉스	116,500	1.75	328.5	67.9	152,311	8,741	-0.05%	-7,536	1,529	8,022	-2,473	299
현대차	200,500	2.56	97.6	66.0	42,061	374	0.04%	1,268	1,437	-2,745	-490	-3,542
삼성 SDI	694,000	1.02	102.7	65.9	28,228	51	0.03%	522	-260	-262	476	-716
호텔신라	72,100	1.98	20.3	63.7	23,510	-3,839	0.06%	1,111	-117	-894	-3,848	-2,801
POSCO	277,000	5.93	175.5	59.8	14,030	-1,411	0.00%	-2,240	-399	2,639	2,606	-1
기아	81,100	4.11	84.7	58.4	48,220	8,478	0.00%	2,859	4,735	-7,594	-3,265	-8,920

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터