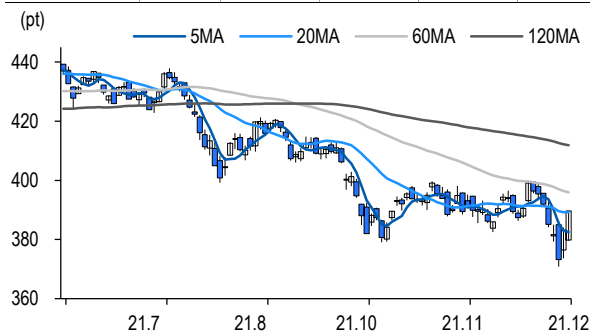


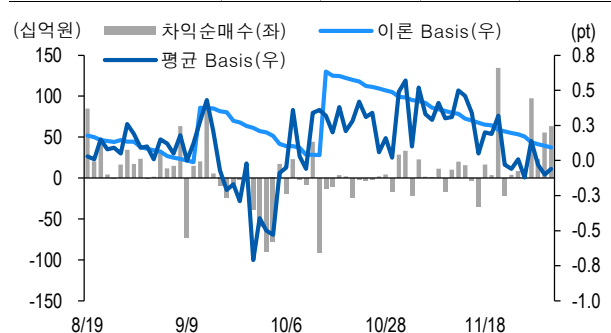
선물옵션시장 지표

2021.12.3

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	389.64	1.70	6.51	9,560.2	-
선물 12월물	389.00	1.57	6.00	35,201.7	277,848
선물 3월물	385.20	1.53	5.80	348.2	16,865
12월물(mini)	388.96	1.56	5.98	2,089.1	55,215
1월물(mini)	384.62	1.50	5.70	17.8	4,722



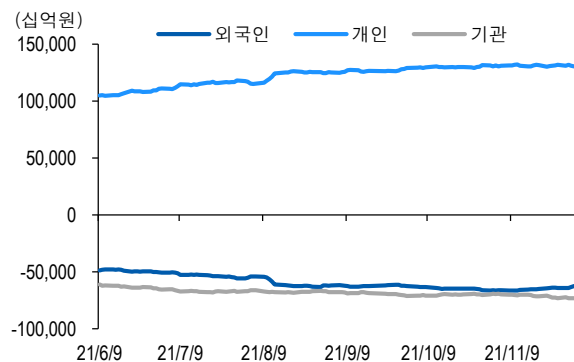
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스	0.09	-0.06	-0.64	-0.04%
베이스(mini)	0.09	-0.06	-0.68	-0.04%
제1스프레드(SP)	-2.75	-3.87	-3.80	-0.29%
합성선물 베이스(ATM)	0.09	-0.59	-0.59	-0.18%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	885.8	-19.7	866.0	0.0	601.1	155.9	87.9	3.4	3.1	-22.4
개인	-919.7	194.5	-725.2	0.0	0.6	36.4	-59.3	1.5	-2.4	33.3
기관	2.1	-163.5	-161.4	63.3	53.7	-201.6	-11.2	-5.6	0.7	-11.5
금융투자	-12.3	-234.5	-246.8	78.1	10.6	-415.6	-10.8	-5.5	1.7	26.5
투신	29.0	3.8	32.8	0.0	12.7	222.5	-0.5	-0.3	-0.3	-46.8
은행+보험+기타금융	-5.1	77.3	72.2	0.0	-6.4	-24.2	0.1	0.2	-0.7	0.1
연기금+국가지자체	36.5	-3.5	33.1	-14.8	31.3	15.6	0.0	0.0	0.0	8.7
기타법인	31.8	-11.3	20.5	0.0	0.0	9.2	-17.4	0.6	-1.5	0.6

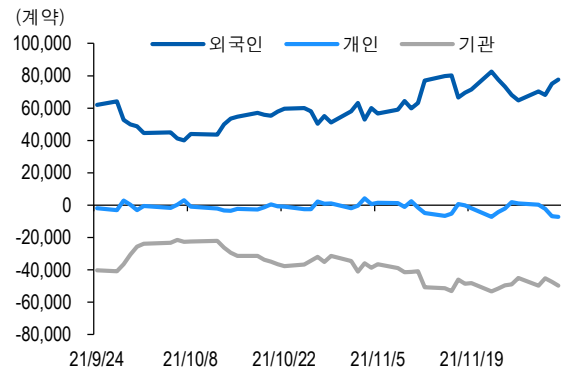
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



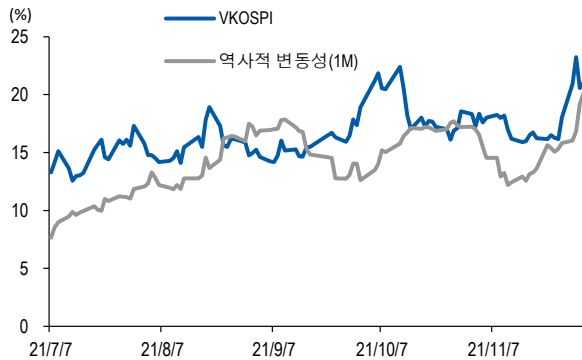
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,740,624	473.4	986,383	17.6%	지수옵션 전체	3,336,356	840.6	2,684,973
Put	1,595,732	367.2	1,698,590	24.2%	PCR(금액기준)	0.78	VKOSPI	21.02%(+0.45%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	390.0(K+3)	3.90	2.38	154,967	23,418	-1,283	17.5	Put	385.0(K+1)	2.93	-2.44	26,103	19,265	834	21.6
	387.5(K+2)	5.33	2.97	65,793	13,846	-572	17.9		382.5(K+0)	2.29	-1.92	29,790	14,722	709	22.4
	385.0(K+1)	7.01	3.60	46,860	13,914	-49	18.4		380.0(K-1)	1.78	-1.49	68,408	31,605	931	23.3
	382.5(K+0)	8.84	4.10	11,062	8,866	-456	18.8		377.5(K-2)	1.37	-1.17	64,886	15,632	2,567	24.0
	380.0(K-1)	10.75	4.44	3,600	9,462	-298	18.5		375.0(K-3)	1.11	-0.85	98,722	24,695	4,492	25.2

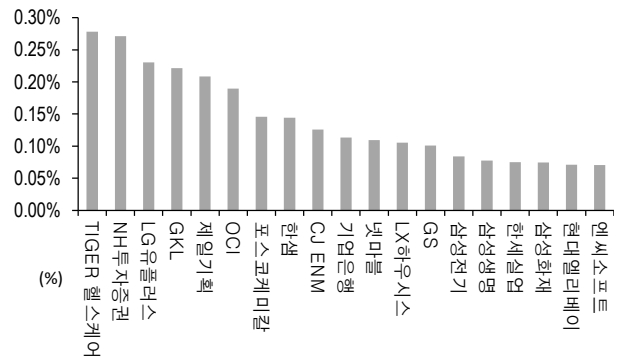
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,660,209	3,972.9	5,092,698	33,226	2,869	11,134	-14,988	-22.4	33.3	-11.5	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
엔씨소프트	693,000	-1.70	127.8	81.4	10,011	529	0.07%	-547	853	-307	69	-719
삼성전자	75,900	2.29	1,412.1	79.8	1,178,624	18,667	0.04%	-15,863	34,830	-19,427	-11,415	-6,671
현대건설	47,350	4.30	16.7	75.1	15,366	823	-0.01%	-1,171	3,809	-2,638	-2,330	-304
SK 하이닉스	119,500	2.58	554.8	68.0	144,269	-8,042	-0.11%	10,587	-658	-10,249	4,225	1,400
기아	81,800	0.86	72.8	67.7	45,972	-2,248	0.05%	329	-4,149	3,820	-1,026	2,336
대한항공	27,750	0.73	34.2	59.9	55,651	157	0.02%	2,748	-620	-2,078	-1,849	7,172
현대차	204,500	2.00	87.9	55.3	38,797	-3,264	-0.02%	-3,765	-722	4,487	-268	3,904
GS 건설	39,150	3.98	8.4	52.9	35,179	-608	0.03%	-1,325	7,088	-5,763	-2,404	-3,359
LG 화학	729,000	1.11	101.2	52.4	9,210	698	0.03%	291	234	-525	-401	-101
KB 금융	54,800	1.86	25.4	50.5	27,836	-918	-0.15%	503	683	-1,192	-1,359	198

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터