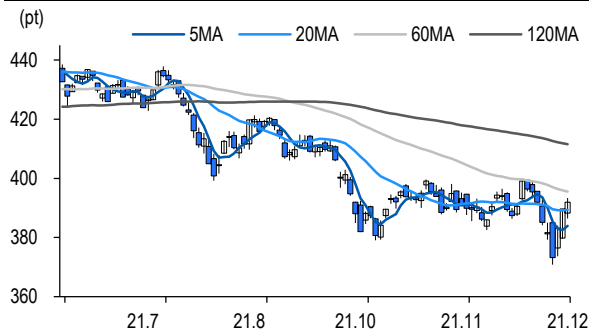


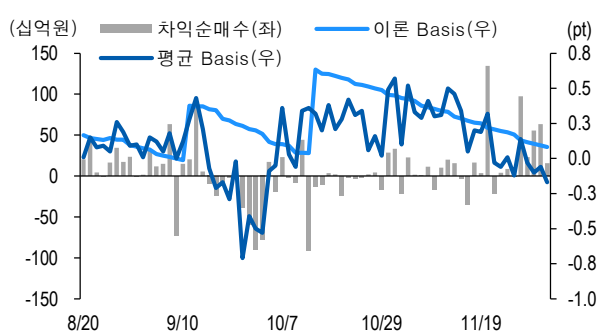
선물옵션시장 지표

2021.12.6

	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	391.96	0.60	2.32	7,837.1	-
선물 12월물	392.25	0.84	3.25	32,947.8	269,865
선물 3월물	388.45	0.84	3.25	717.6	24,958
12월물(mini)	392.36	0.86	3.40	2,226.4	54,270
1월물(mini)	388.14	0.92	3.52	17.3	4,929



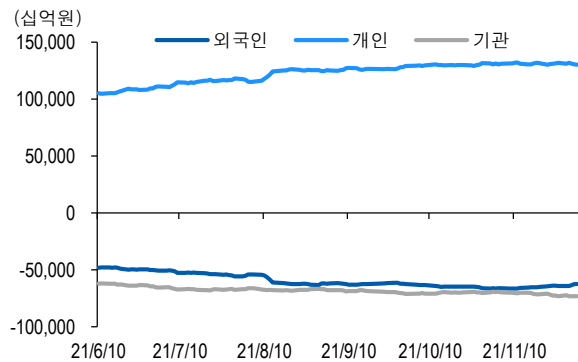
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.08	-0.17	0.29	-0.06%
베이스스(mini)	0.08	-0.17	0.40	-0.06%
제1스프레드(SP)	-2.74	-3.84	-3.85	-0.28%
합성선물 베이스스(ATM)	0.08	0.30	0.30	0.06%



	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	155.0	-2.3	152.7	-1.9	89.2	298.7	3.5	-10.6	1.9	-14.6
개인	-269.1	15.0	-254.0	0.0	-1.2	-1.1	0.2	13.4	-3.1	31.1
기관	88.6	-21.7	66.9	17.5	42.9	-295.1	-0.4	-3.3	2.6	-21.0
금융투자	-98.2	-14.4	-112.5	13.7	3.2	-85.4	-2.1	-3.5	2.9	-32.3
투신	27.6	-2.3	25.3	0.0	13.9	-217.8	1.7	0.2	-0.2	24.8
은행+보험+기타금융	-7.7	9.7	1.9	0.0	-6.1	4.3	0.0	0.0	-0.1	0.8
연기금+국가자재	153.7	-3.2	150.6	3.7	29.5	3.8	0.0	0.0	0.0	-14.3
기타법인	25.5	9.0	34.4	0.0	-1.3	-2.4	-3.2	0.6	-1.4	4.4

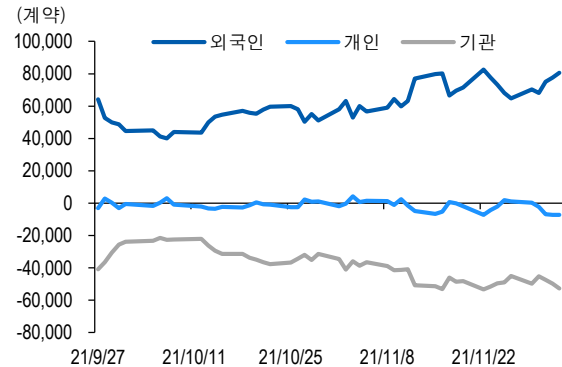
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



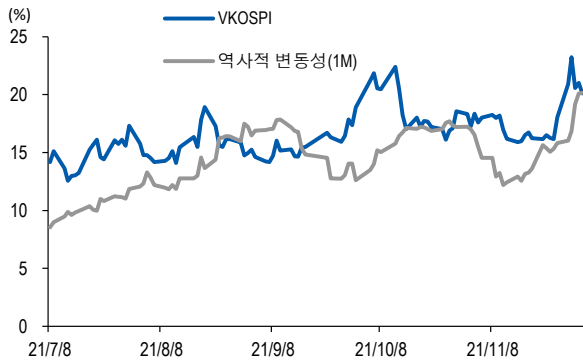
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,408,845	601.2	1,025,879	17.2%	지수옵션 전체	4,455,935	1,065.2	2,793,714
Put	2,047,090	464.0	1,767,835	20.4%	PCR(금액기준)	0.77	VKOSPI	20.09%(-0.93%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	397.5(K+3)	1.59	0.41	281,606	22,699	1,679	16.9	Put	392.5(K+1)	3.96	-2.22	11,519	6,672	1,235	17.2
	395.0(K+2)	2.49	0.66	241,142	20,547	-3,171	17.4		390.0(K+0)	3.00	-1.87	31,716	19,905	1,401	18.3
	392.5(K+1)	3.70	0.94	138,116	18,316	-2,467	18.1		387.5(K-1)	2.23	-1.58	46,991	11,923	1,073	19.1
	390.0(K+0)	5.26	1.36	76,230	20,669	-2,749	19.2		385.0(K-2)	1.66	-1.27	100,663	20,231	966	20.0
	387.5(K-1)	6.99	1.66	22,573	13,066	-780	20.2		382.5(K-3)	1.19	-1.10	103,377	18,512	3,790	20.7

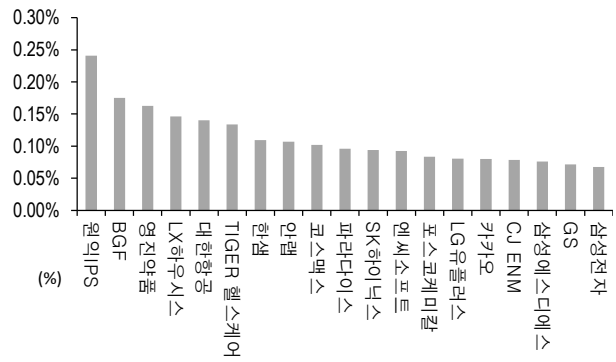
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스 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	4,336,228	3,484.8	5,213,755	121,057	-42,847	37,265	1,863	-14.6	31.1	-21.0

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	75,800	-0.13	1,292.5	97.6	1,225,025	46,401	0.07%	-10,045	29,326	-23,263	-20,526	-17,161
대한항공	28,550	2.88	48.7	77.0	74,658	19,007	0.14%	-6,783	2,572	4,314	-11,938	-16,543
GS 건설	39,700	1.40	9.7	72.9	36,002	823	0.02%	-774	1,350	-576	-2,334	1,758
기아	82,400	0.73	75.7	70.8	39,320	-6,652	-0.05%	-1,869	48	1,824	1,711	5,057
SK 하이닉스	118,500	-0.84	339.0	64.5	155,057	10,788	0.09%	-2,980	3,676	-1,716	-5,907	-1,200
호텔신라	76,000	3.40	22.7	62.8	17,724	-3,748	0.01%	-4,182	-810	5,010	-1,300	-208
LG 화학	721,000	-1.10	87.8	62.1	9,552	342	0.06%	595	93	-688	-633	-46
영진약품	4,310	1.17	0.8	61.9	10,783	1,970	0.16%	2,080	-121	-1,959	-1,970	11
현대건설	48,350	2.11	14.1	60.4	16,077	711	-0.02%	-1,563	-64	1,627	376	1,243
SK 이노베이션	206,000	1.23	26.9	59.4	16,139	-1,071	0.06%	-846	-330	1,176	151	1,025

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터