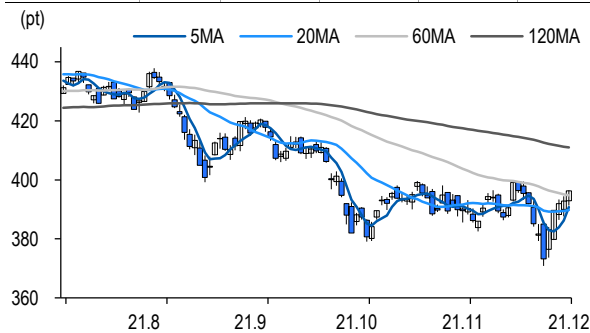


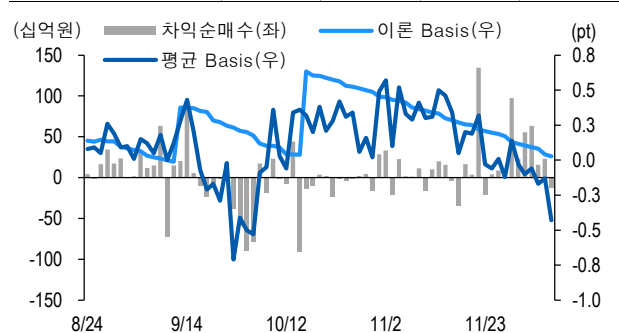
선물옵션시장 지표

2021.12.8

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	396.31	0.88	3.46	7,361.5	-
선물 12월물	396.15	0.98	3.85	29,601.3	182,285
선물 3월물	392.70	1.04	4.05	3,331.4	163,634
12월물(mini)	396.20	0.99	4.00	1,885.2	55,067
1월물(mini)	392.28	1.05	4.06	25.7	5,699



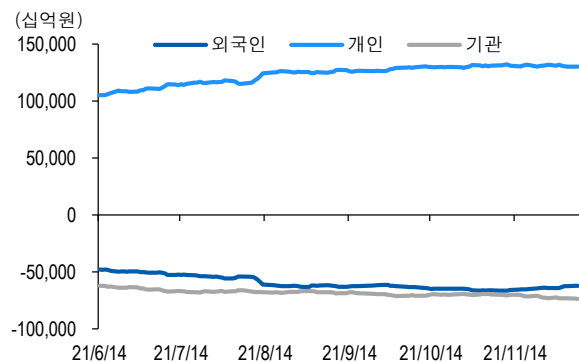
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.03	-0.43	-0.16	-0.12%
베이스(mini)	0.03	-0.43	-0.11	-0.12%
제1스프레드(SP)	-2.72	-3.51	-3.60	-0.20%
합성선물 베이스(ATM)	0.03	-0.15	-0.15	-0.04%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	206.6	8.1	214.7	0.0	-13.2	-49.0	-0.3	0.2	2.7	-34.8
개인	-138.7	202.9	64.2	0.0	0.4	-12.1	-3.1	-0.8	-5.5	23.5
기관	-79.8	-231.8	-311.6	-12.2	-5.5	71.2	4.4	0.4	3.6	10.5
금융투자	-117.8	-172.3	-290.1	-6.4	4.3	110.2	4.3	-0.2	3.6	-54.9
투신	62.1	-12.9	49.2	0.0	3.1	-98.0	0.1	0.5	0.0	26.1
은행+보험+기타금융	-15.9	22.5	6.6	0.0	-6.0	56.3	0.0	0.1	0.0	-0.7
연기금+국가지자체	-70.7	-62.6	-133.2	-5.8	-6.1	2.6	0.0	0.0	0.0	40.0
기타법인	11.9	20.8	32.7	0.0	0.2	-10.1	-1.0	0.2	-0.8	0.8

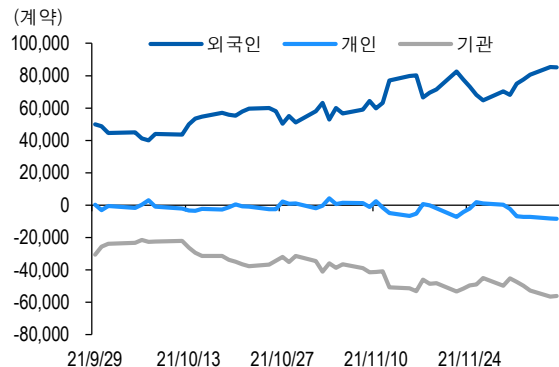
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



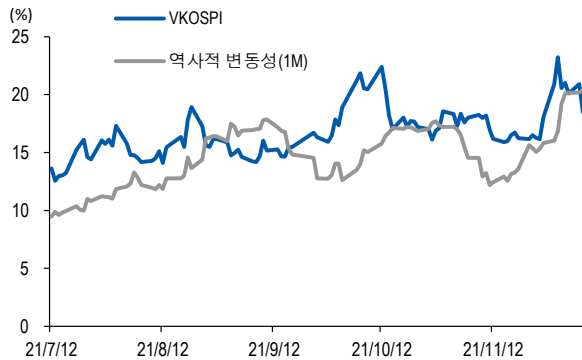
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	2,202,428	474.9	1,080,869	15.3%	지수옵션 전체	4,362,338	841.3	2,969,357
Put	2,159,910	366.5	1,888,488	19.8%	PCR(금액기준)	0.77	VKOSPI	18.48%(-2.43%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	400.0(K+3)	0.82	0.04	446,622	38,362	1,634	15.1	Put	395.0(K+1)	1.82	-3.17	43,592	11,557	4,295	17.0
	397.5(K+2)	1.68	0.30	302,897	23,494	-440	15.4		392.5(K+0)	1.09	-2.64	90,857	12,857	3,291	18.0
	395.0(K+1)	3.00	0.74	195,917	20,144	-648	15.8		390.0(K-1)	0.62	-2.08	197,678	25,426	2,441	18.8
	392.5(K+0)	4.75	1.27	72,161	18,187	-461	16.4		387.5(K-2)	0.34	-1.58	213,976	23,432	6,322	19.6
	390.0(K-1)	6.80	1.84	21,241	20,578	-3,026	16.9		385.0(K-3)	0.19	-1.17	273,326	27,000	3,257	20.6

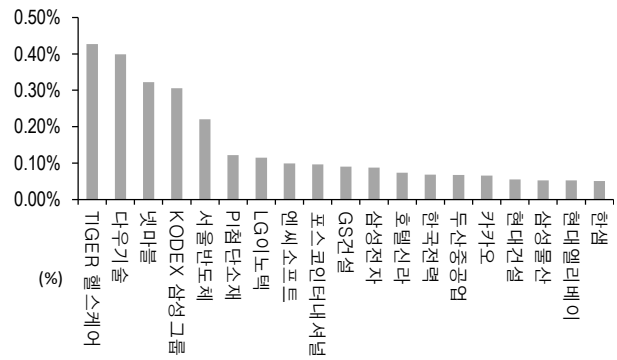
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,745,406	3,551.8	5,985,891	317,166	-83,497	-3,069	84,813	-34.8	23.5	10.5	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
넷마블	120,000	1.27	19.8	98.9	6,021	-3,595	0.32%	-676	-43	720	-4,254	-557
삼성전자	77,500	1.44	1,034.0	74.4	1,018,058	-125,727	0.09%	-6,494	6,458	-1,650	-55,948	18,100
엔씨소프트	719,000	0.84	112.9	71.0	8,580	-237	0.10%	-10	1,109	-1,134	-646	-519
현대차	207,000	0.00	70.1	68.8	30,473	-6,377	-0.01%	-1,294	2,894	-1,600	-2,047	447
LG 화학	707,000	-1.26	75.0	62.7	6,958	-2,018	-0.16%	-240	28	212	398	698
하나금융지주	42,850	0.59	17.1	58.3	83,609	-4,740	-0.09%	-2,843	323	2,801	2,314	504
POSCO	288,500	0.70	50.4	56.8	8,920	-1,667	-0.16%	-686	-160	797	1,233	223
대한항공	29,600	1.54	32.1	56.7	82,403	8,014	0.05%	-5,325	4,238	1,087	-9,810	3,065
SK 하이닉스	122,000	2.52	334.5	54.5	155,494	-16,677	-0.09%	-336	-2,856	3,100	1,691	1,900
삼성전기	181,000	0.84	63.1	54.3	25,989	-4,286	-0.05%	-1,006	-2,900	3,945	-77	2,114

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터