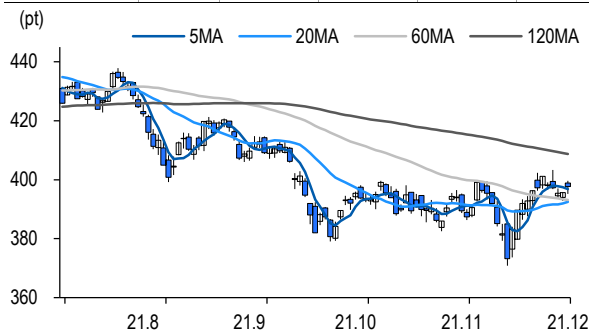


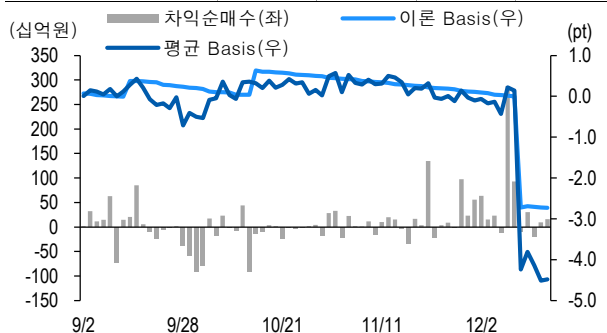
선물옵션시장 지표

2021.12.17

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	397.68	0.51	2.02	6,304.9	-
선물 3월물	393.50	0.68	2.65	23,895.7	228,369
선물 6월물	393.40	0.60	2.35	14.2	9,675
1월물(mini)	392.98	0.67	2.62	1,872.2	29,986
2월물(mini)	393.40	0.68	2.64	2.1	889



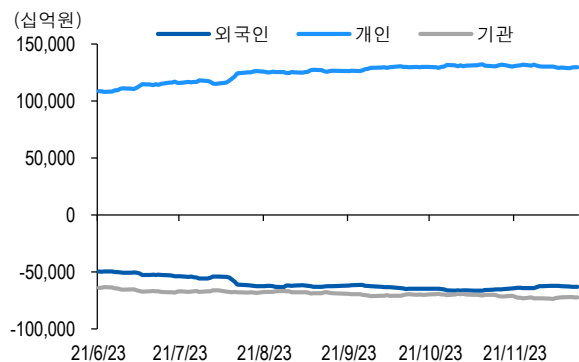
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-2.73	-4.48	-4.18	-0.44%
베이스(mini)	-3.49	-4.98	-4.70	-0.37%
제1스프레드(SP)	0.63	0.18	0.15	-0.11%
합성선물 베이스(ATM)	-3.49	-4.76	-4.76	-0.32%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	183.1	-9.6	173.5	0.0	153.6	-197.5	-47.7	-1.2	-1.8	-4.2
개인	-168.8	-5.2	-174.0	0.0	0.5	-60.4	-27.4	0.5	-2.9	16.6
기관	-51.5	15.8	-35.7	16.4	-74.2	272.3	76.0	0.7	4.6	-12.8
금융투자	96.5	9.5	106.0	-1.4	-6.8	202.9	75.4	0.5	4.0	-36.3
투신	-40.3	-10.2	-50.5	0.0	-12.6	93.0	0.7	0.1	0.0	32.6
은행+보험+기타금융	-39.0	18.4	-20.7	0.0	-9.0	-3.6	-0.1	0.1	0.6	-0.6
연기금+국가지자체	-26.6	-1.4	-28.0	17.8	-41.7	-20.0	0.0	0.0	0.0	-8.6
기타법인	37.2	-0.9	36.3	0.0	0.1	-14.3	-0.9	0.1	0.1	0.5

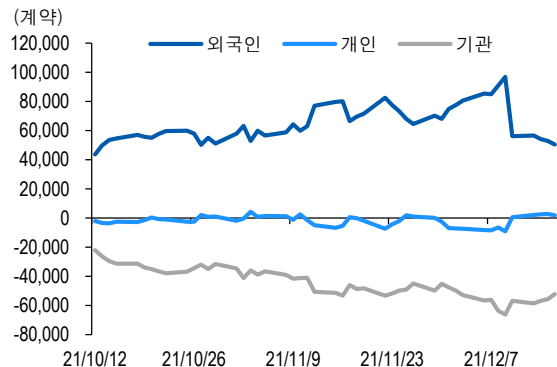
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



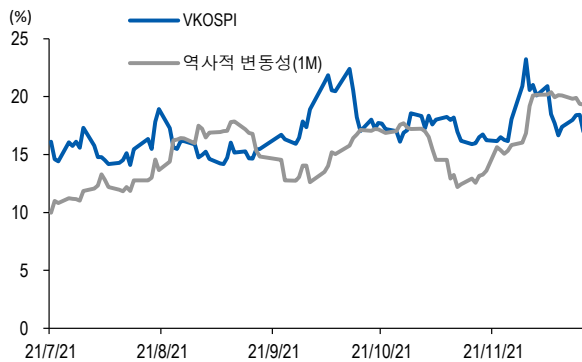
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	634,665	239.0	561,758	13.6%	지수옵션 전체	1,220,831	457.6	1,532,452
Put	586,166	218.5	970,694	17.0%	PCR(금액기준)	0.91	VKOSPI	16.98%(-1.45%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	402.5(K+3)	2.80	0.25	104,722	9,648	-160	13.6	Put	397.5(K+1)	9.23	-2.02	337	1,741	85	16.8
	400.0(K+2)	3.60	0.34	30,815	15,206	-504	13.6		395.0(K+0)	7.78	-2.02	3,580	3,570	93	16.6
	397.5(K+1)	4.59	0.46	12,823	5,901	517	13.7		392.5(K-1)	6.56	-1.93	5,540	4,255	876	16.7
	395.0(K+0)	5.70	0.56	9,108	5,524	-166	13.7		390.0(K-2)	5.51	-1.79	9,443	7,908	1,140	16.8
	392.5(K-1)	6.99	0.70	4,859	4,846	71	13.8		387.5(K-3)	4.64	-1.58	6,039	4,697	406	17.1

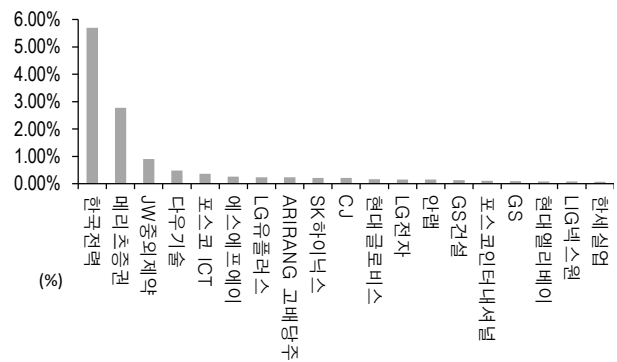
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,465,223	2,310.5	4,917,438	74,584	-21,734	34,531	-14,107	-4.2	16.6	-12.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	332,500	0.15	121.6	84.7	17,045	49	0.00%	-1,493	-663	2,162	2,724	-1,124
호텔신라	75,600	0.00	10.8	80.7	20,235	3,971	-0.58%	1,805	-1,823	19	2,396	-191
SK	253,000	0.60	26.5	79.8	7,116	26	0.07%	-501	204	293	-171	464
현대차	207,000	0.24	73.0	76.5	56,638	796	0.03%	-1,011	1,057	-86	-852	766
SK 하이닉스	123,500	0.41	360.0	75.3	199,950	23,396	0.22%	-4,853	21,089	-15,996	-23,200	-50
삼성전자	77,300	0.65	658.0	70.7	1,431,605	1,955	-0.25%	-4,422	-3,765	8,367	-17,426	14,215
GS 건설	40,450	-0.25	6.4	65.2	44,680	-1,986	0.13%	6	486	-494	58	1,842
현대제철	42,250	0.48	8.9	52.3	17,747	2,553	-0.38%	-499	326	198	-2,538	285
삼성전기	180,500	0.28	40.9	49.4	29,861	-2,643	-0.34%	-817	1,529	-719	1,160	714
카카오	119,500	0.42	68.6	49.3	78,264	-2,336	0.03%	2,479	-2,828	349	-2,437	-1,020

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터