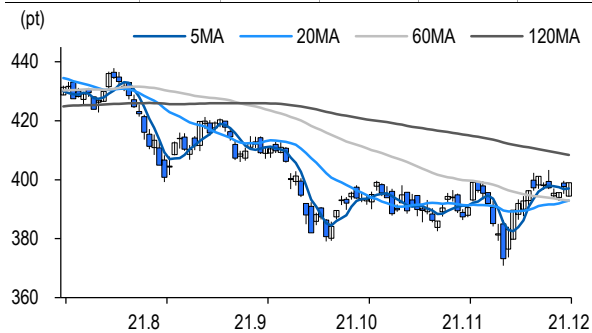


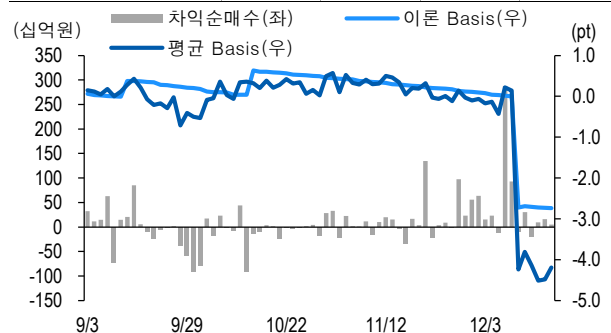
선물옵션시장 지표

2021.12.20

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	398.96	0.32	1.28	8,381.1	-
선물 3월물	393.95	0.11	0.45	23,081.0	229,287
선물 6월물	394.00	0.15	0.60	12.8	9,674
1월물(mini)	393.44	0.12	0.46	1,744.6	34,546
2월물(mini)	394.00	0.15	0.60	4.3	1,041



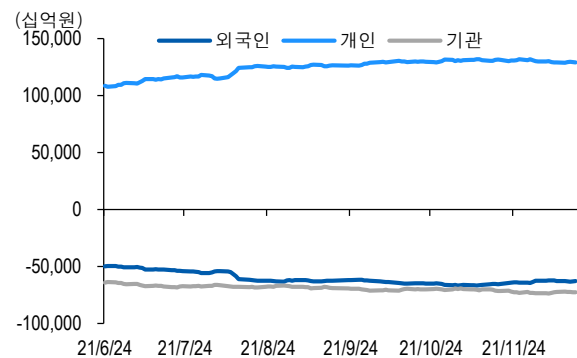
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-2.74	-4.19	-5.01	-0.36%
베이스(mini)	-3.51	-4.77	-5.52	-0.32%
제1스프레드(SP)	0.64	0.21	0.20	-0.11%
합성선물 베이스(ATM)	-3.51	-5.57	-5.57	-0.52%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	531.5	-140.5	390.9	3.1	424.3	465.6	-71.2	-0.4	-1.6	39.5
개인	-527.0	238.3	-288.7	0.0	0.0	-143.6	26.9	0.6	0.0	32.9
기관	-13.7	-100.3	-114.0	2.2	3.1	-317.7	47.8	-0.3	2.3	-71.1
금융투자	141.2	-136.7	4.5	2.4	-3.6	-456.1	47.8	-0.1	2.4	-67.6
투신	-24.0	-6.3	-30.4	0.0	1.4	146.0	0.1	-0.1	0.0	-2.5
은행+보험+기타금융	-16.8	17.7	0.9	0.0	-17.1	-7.1	-0.1	0.0	-0.1	-0.2
연기금+국가지자체	-5.4	18.0	12.6	-0.2	32.3	-0.6	0.0	0.0	0.0	-0.8
기타법인	9.2	2.5	11.7	0.0	0.6	-4.2	-3.4	0.0	-0.6	-1.3

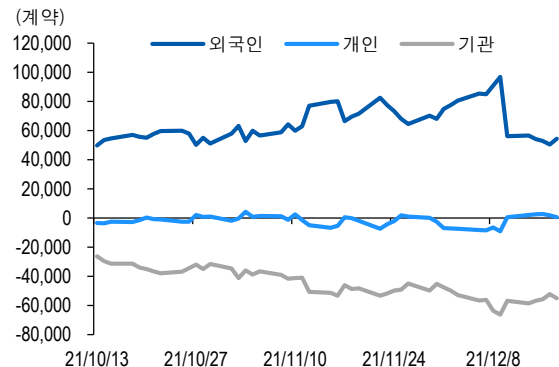
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



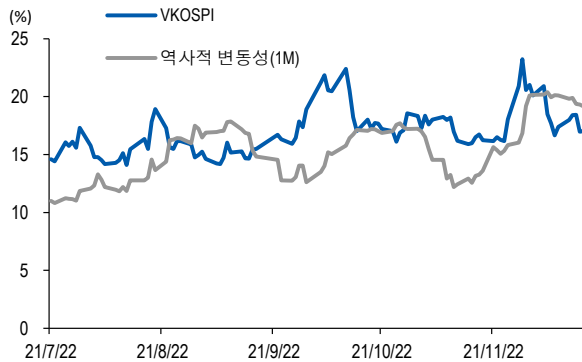
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	618,341	234.3	578,971	12.7%	지수옵션 전체	1,185,016	426.4	1,613,863
Put	566,675	192.1	1,034,892	17.7%	PCR(금액기준)	0.82	VKOSPI	17.02%(+0.04%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	405.0(K+3)	2.10	-0.06	73,011	20,169	2,258	12.7	Put	400.0(K+1)	10.20	-0.60	519	5,141	266	17.6
	402.5(K+2)	2.80	0.00	92,848	10,671	1,023	12.8		397.5(K+0)	8.71	-0.52	606	1,880	139	17.5
	400.0(K+1)	3.64	0.04	36,491	15,937	731	12.8		395.0(K-1)	7.43	-0.35	3,345	3,674	104	17.6
	397.5(K+0)	4.60	0.01	13,588	6,560	659	12.7		392.5(K-2)	6.25	-0.31	3,750	4,767	512	17.6
	395.0(K-1)	5.77	0.07	7,392	6,412	888	12.7		390.0(K-3)	5.24	-0.27	7,249	8,591	683	17.7

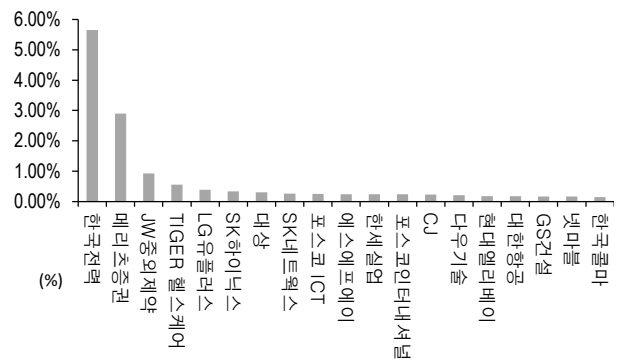
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,398,244	2,063.4	4,994,378	76,940	99,255	29,803	-127,840	39.5	32.9	-71.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	326,000	-1.95	131.9	91.7	17,009	-36	0.03%	10	4,220	-4,238	-2,620	-1,377
SK 하이닉스	121,500	-1.62	306.8	68.1	215,264	15,314	0.33%	11,473	6,135	-17,608	-16,979	140
삼성전자	77,300	0.00	538.5	58.8	1,414,194	-17,411	-0.30%	-7,677	-14,666	22,781	5,916	21,349
SK 이노베이션	230,000	1.55	89.4	54.0	25,217	4,078	-0.51%	-2,637	922	1,682	-3,268	319
현대차	208,000	0.48	70.0	54.0	59,075	2,437	0.02%	2,291	2,042	-4,333	-1,638	-2,695
현대제철	43,750	3.55	19.4	45.4	27,718	9,971	-0.31%	1,861	1,382	-3,268	-9,522	-1,637
호텔신라	76,400	1.06	5.6	45.4	20,580	345	-0.40%	760	206	-966	217	-1,183
대한항공	29,300	1.03	15.0	45.3	139,608	11,590	0.17%	11,490	-2,004	-9,486	-9,115	-4,226
POSCO	282,000	2.92	63.6	44.2	28,469	2,802	-1.88%	92	851	-947	-2,818	425
LG 전자	128,500	-0.77	51.7	42.6	42,598	360	0.10%	348	1,177	-1,475	-3,980	2,505

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터