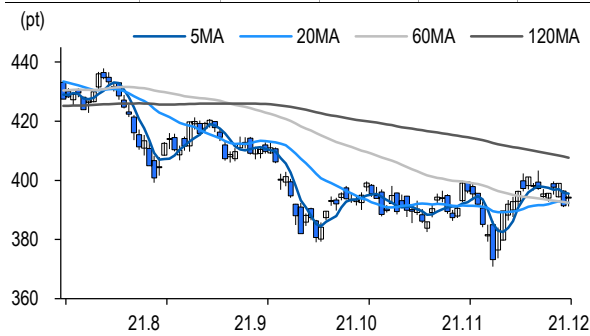


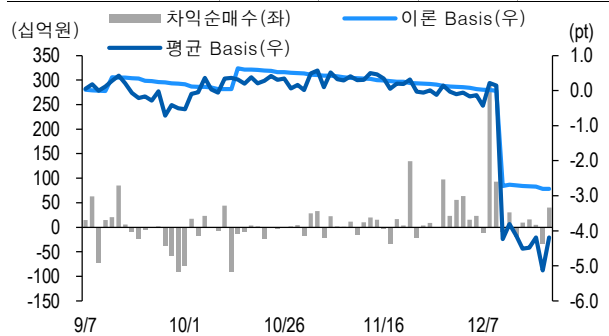
선물옵션시장 지표

2021.12.22

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	393.95	0.66	2.58	6,345.3	-
선물 3월물	389.50	0.75	2.90	23,049.8	232,491
선물 6월물	389.60	0.75	2.90	19.5	9,970
1월물(mini)	388.90	0.70	2.72	2,246.0	44,477
2월물(mini)	389.10	0.69	2.66	2.7	631



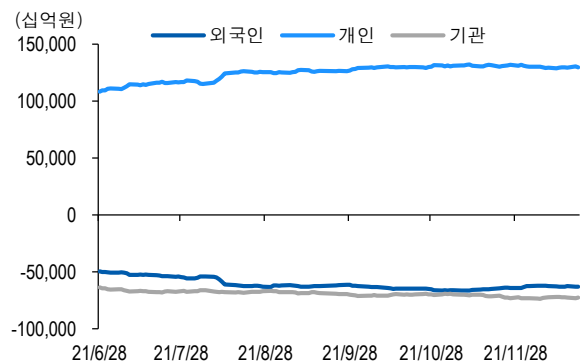
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-2.81	-4.19	-4.45	-0.35%
베이스(mini)	-3.57	-4.82	-5.05	-0.32%
제1스프레드(SP)	0.62	0.13	0.15	-0.12%
합성선물 베이스(ATM)	-3.57	-4.99	-4.99	-0.36%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	32.4	24.0	56.4	0.0	69.0	212.1	-154.3	-2.9	-1.0	36.4
개인	-649.2	-24.9	-674.1	0.0	1.3	148.3	23.8	0.9	-0.4	-35.1
기관	599.2	6.5	605.7	40.4	-11.8	-356.5	130.1	2.1	1.4	-2.0
금융투자	585.3	20.2	605.4	12.9	14.9	-619.0	130.1	2.0	1.0	13.0
투신	-7.7	-3.9	-11.6	0.0	-6.9	301.4	0.0	0.0	0.1	48.6
은행+보험+기타금융	-25.3	14.4	-11.0	0.0	-6.2	-1.0	0.0	0.0	0.4	0.2
연기금+국가자재	23.0	-8.4	14.6	27.6	-22.1	-37.9	0.0	0.0	0.0	-63.9
기타법인	17.6	-5.7	11.9	0.0	0.4	-3.9	0.4	-0.1	0.0	0.7

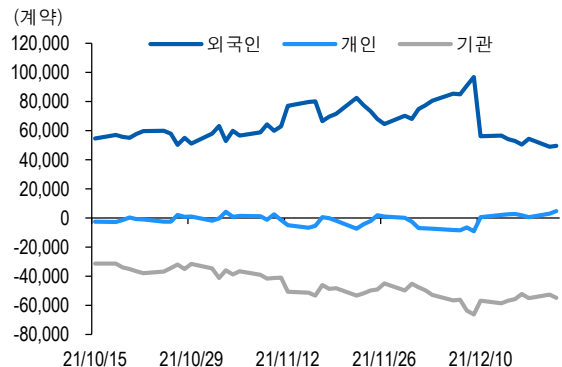
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	551,726	194.6	638,252	14.2%	지수옵션 전체	1,120,243	407.9	1,712,178
Put	568,517	213.3	1,073,926	18.3%	PCR(금액기준)	1.10	VKOSPI	18.32%(-1.20%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	400.0(K+3)	2.20	0.34	68,564	21,127	2,894	14.3	Put	395.0(K+1)	9.77	-2.23	695	3,297	-120	18.0
	397.5(K+2)	2.89	0.43	39,583	8,301	1,096	14.3		392.5(K+0)	8.30	-2.15	1,328	4,576	-151	18.0
	395.0(K+1)	3.74	0.57	25,427	8,475	136	14.3		390.0(K-1)	7.01	-1.93	4,637	8,290	-514	18.1
	392.5(K+0)	4.76	0.72	7,902	6,159	302	14.4		387.5(K-2)	5.89	-1.78	4,310	5,292	325	18.2
	390.0(K-1)	5.99	0.88	5,560	5,710	111	14.5		385.0(K-3)	4.94	-1.62	9,639	8,712	-174	18.5

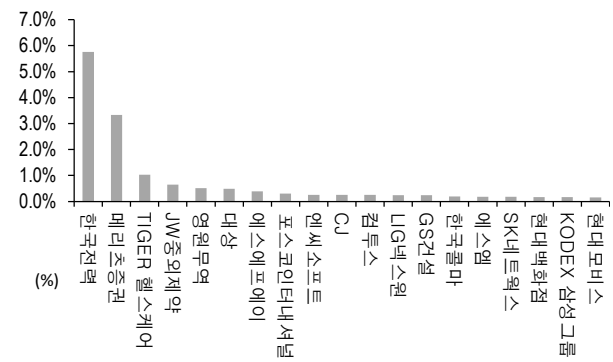
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)	
주식선물 전체	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	
	3,080,011	2,590.6	5,122,661	173,504	5,861	-54,570	49,020	36.4	-35.1	-2.0	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	335,500	6.17	204.5	92.7	14,943	1,965	0.04%	762	-3,152	2,405	3,343	-3,426
현대제철	42,000	0.12	13.2	88.8	30,040	-1,593	-0.35%	-3,154	-568	3,772	2,870	902
하나투어	71,400	4.54	5.6	87.5	7,691	203	-0.73%	572	-587	15	-3,129	-50
호텔신라	75,400	1.07	12.1	78.2	19,244	-1,148	-0.40%	-277	247	30	-235	265
삼성전자	77,400	1.31	786.4	75.5	1,469,062	69,214	-0.22%	10,035	1,448	-11,663	-1,842	-46,800
삼성전기	177,000	2.61	55.2	74.8	23,930	-54	-0.49%	2,261	-4,224	1,963	3,885	-418
대한항공	29,000	1.05	18.7	73.3	153,872	11,745	0.10%	1,026	-1,900	874	-12,582	442
현대차	201,500	-0.25	76.9	68.3	59,127	104	0.02%	248	-376	128	1,039	-911
SK 이노베이션	214,000	-0.93	48.1	64.8	19,142	110	-1.04%	-79	-135	194	2,074	-227
LG 전자	129,000	3.61	74.3	58.0	30,011	750	-0.17%	2,725	2,507	-5,112	-1,749	-2,011

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터