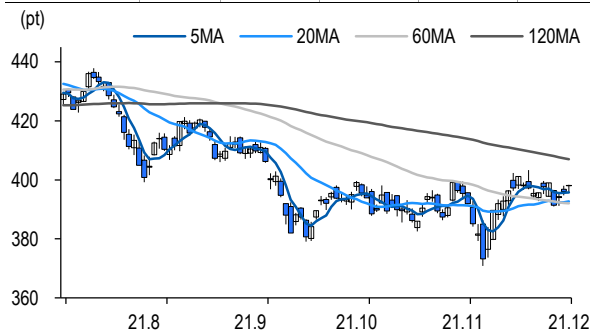


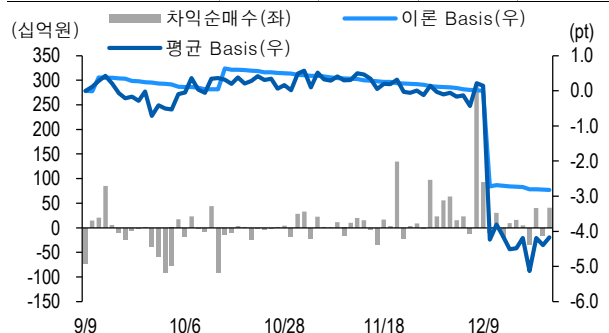
선물옵션시장 지표

2021.12.24

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	398.15	0.53	2.08	6,568.8	-
선물 3월물	393.60	0.51	2.00	16,827.9	231,805
선물 6월물	393.75	0.50	1.95	9.3	10,103
1월물(mini)	392.88	0.48	1.88	1,687.2	49,685
2월물(mini)	393.62	0.54	2.12	4.6	2,716



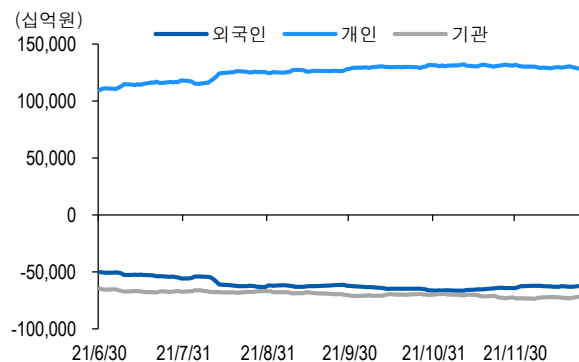
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-2.82	-4.17	-4.55	-0.34%
베이스(mini)	-3.59	-4.81	-5.27	-0.31%
제1스프레드(SP)	0.63	0.20	0.20	-0.11%
합성선물 베이스(ATM)	-3.59	-5.26	-5.26	-0.42%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	224.4	-3.9	220.6	0.0	184.5	403.9	-130.8	1.3	6.3	0.1
개인	-818.8	79.9	-738.9	0.0	0.0	19.3	16.7	-0.3	-2.2	101.1
기관	578.7	-85.2	493.5	41.0	-1.2	-418.2	117.3	-0.9	-3.5	-101.8
금융투자	587.4	-48.6	538.9	14.9	4.3	-633.8	118.3	-0.8	-3.1	-177.8
투신	-12.6	-5.3	-17.8	4.0	-3.3	261.8	-1.5	0.0	0.0	78.6
은행+보험+기타금융	-26.2	-31.1	-57.3	2.4	-13.0	-37.1	0.5	-0.1	-0.4	0.0
연기금+국가지자체	-23.0	-2.0	-25.1	17.8	-1.7	-9.1	0.0	0.0	0.0	-2.5
기타법인	15.7	9.1	24.7	0.0	0.0	-4.9	-3.2	-0.1	-0.5	0.6

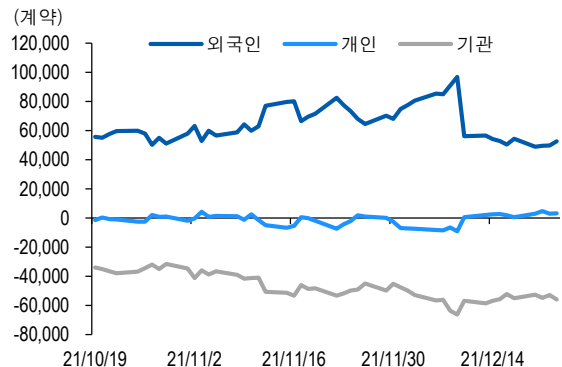
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



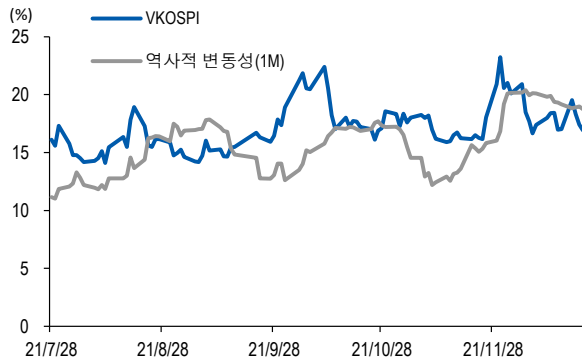
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	385,956	138.5	659,713	12.5%	지수옵션 전체	840,629	281.6	1,799,828			
Put	454,673	143.1	1,140,115	17.0%	PCR(금액기준)	1.03	VKOSPI	16.93%(-0.49%p)			

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	402.5(K+3)	1.90	0.17	43,760	15,717	667	12.5	Put	397.5(K+1)	8.09	-1.52	2,018	2,259	129	16.8
	400.0(K+2)	2.62	0.26	39,785	19,254	-641	12.5		395.0(K+0)	6.65	-1.42	2,132	3,592	293	16.6
	397.5(K+1)	3.47	0.33	17,652	8,938	727	12.4		392.5(K-1)	5.45	-1.25	3,931	5,366	538	16.7
	395.0(K+0)	4.54	0.44	10,432	9,330	660	12.3		390.0(K-2)	4.41	-1.14	9,114	8,668	334	16.8
	392.5(K-1)	5.83	0.57	3,604	6,429	104	12.3		387.5(K-3)	3.58	-1.00	11,021	6,636	639	17.0

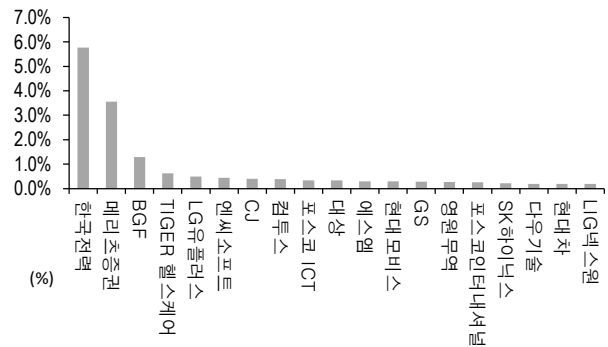
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,437,247	2,249.0	5,497,682	157,895	-1,020	108,468	-107,708	0.1	101.1	-101.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	362,000	8.22	243.6	88.2	17,959	2,758	0.03%	760	-525	-238	-625	174
SK 하이닉스	126,500	0.40	239.9	78.6	265,351	1,103	0.22%	-1,034	-2,594	3,810	-5,265	3,400
삼성전자	79,400	0.63	670.4	62.5	1,676,148	62,842	-0.08%	-17,011	41,806	-25,021	-57,025	3,829
삼성 SDI	640,000	1.59	91.8	55.2	34,683	1,593	0.13%	300	1,585	-1,890	-1,854	-226
SK 이노베이션	216,000	2.13	27.2	51.3	21,801	1,394	-0.80%	-238	64	169	-929	145
GS 건설	40,150	0.12	6.5	51.3	49,113	-3,056	0.10%	2,034	-63	-1,971	861	305
삼성전기	184,000	3.08	66.4	49.1	31,621	8,363	-0.15%	550	1,387	-1,736	-5,100	-2,363
LG 전자	136,000	5.84	166.7	47.9	50,568	21,777	0.12%	1,821	11,879	-13,960	-20,142	-1,798
NAVER	376,500	-0.13	59.0	44.3	33,733	968	0.00%	495	934	-1,429	-587	-808
엔씨소프트	650,000	-1.37	34.7	42.7	15,387	512	0.44%	513	145	-657	-819	-326

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터