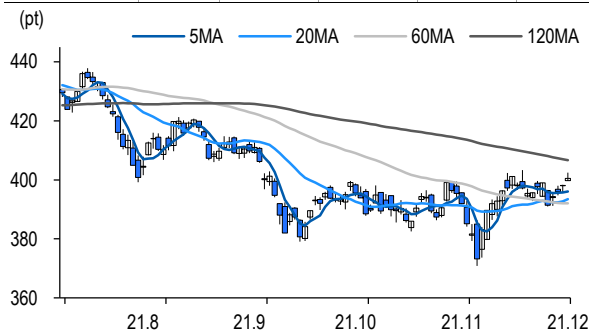


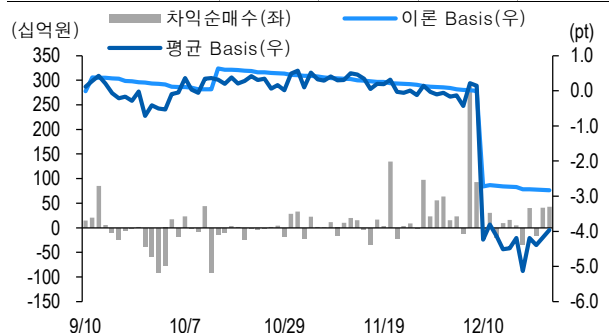
## 선물옵션시장 지표

2021.12.27

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	400.53	0.60	2.38	6,183.4	-
선물 3월물	397.00	0.86	3.40	14,553.6	238,406
선물 6월물	396.85	0.79	3.10	11.8	10,170
1월물(mini)	396.04	0.80	3.16	1,537.9	55,890
2월물(mini)	396.48	0.73	2.86	4.0	3,713



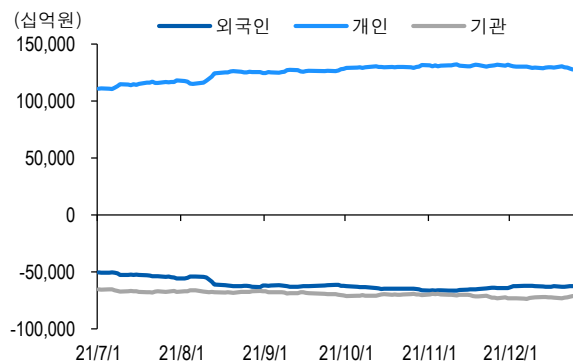
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-2.83	-3.96	-3.53	-0.28%
베이스(mini)	-3.60	-4.68	-4.49	-0.27%
제1스프레드(SP)	0.64	0.15	0.15	-0.12%
합성선물 베이스(ATM)	-3.60	-4.48	-4.48	-0.22%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	189.4	-25.3	164.1	0.0	99.4	680.9	-122.4	1.6	0.7	2.4
개인	-1,130.2	139.7	-990.5	0.0	-2.1	9.7	-40.4	-0.1	-1.6	128.7
기관	917.0	-112.8	804.2	42.7	-13.1	-641.3	167.5	-2.1	1.0	-136.4
금융투자	809.6	-67.1	742.6	22.6	-2.4	-588.7	160.5	-2.1	1.1	-242.8
투신	10.7	-3.7	6.9	0.0	-5.5	-39.5	-1.1	0.0	-0.1	90.6
은행+보험+기타금융	-27.7	-33.5	-61.2	0.0	-16.3	15.1	-0.5	0.0	0.0	-1.0
연기금+국가자재	19.9	-6.8	13.1	20.1	9.3	-28.3	8.6	0.0	0.0	16.8
기타법인	23.7	-1.5	22.2	0.0	-2.5	-49.2	-4.7	0.6	0.0	5.3

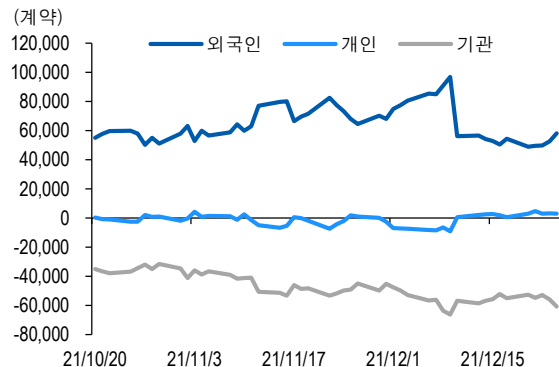
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

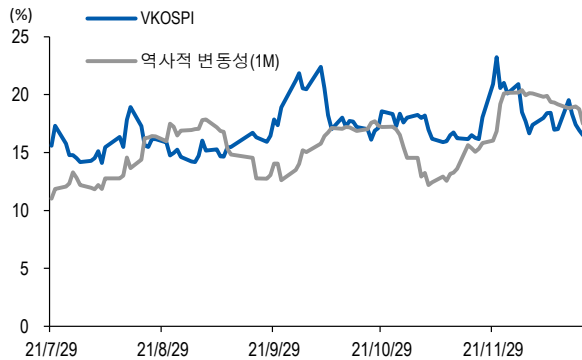
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	576,141	200.6	666,051	12.8%	지수옵션 전체	1,039,160	337.5	1,816,136
Put	463,019	137.0	1,150,085	15.8%	PCR(금액기준)	0.68	VKOSPI	16.50%(-0.43%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	405.0(K+3)	1.90	0.51	70,867	26,126	-1,845	12.8	Put	400.0(K+1)	7.49	-2.25	1,067	5,759	284	15.3
	402.5(K+2)	2.61	0.71	43,958	15,806	89	12.8		397.5(K+0)	6.07	-2.02	5,594	3,214	955	15.2
	400.0(K+1)	3.53	0.91	29,521	20,237	983	12.9		395.0(K-1)	4.90	-1.75	7,610	4,794	1,202	15.4
	397.5(K+0)	4.62	1.15	9,725	9,495	557	12.9		392.5(K-2)	3.91	-1.54	8,510	5,072	-294	15.5
	395.0(K-1)	6.02	1.48	6,337	9,576	246	13.2		390.0(K-3)	3.10	-1.31	24,969	9,581	913	15.8

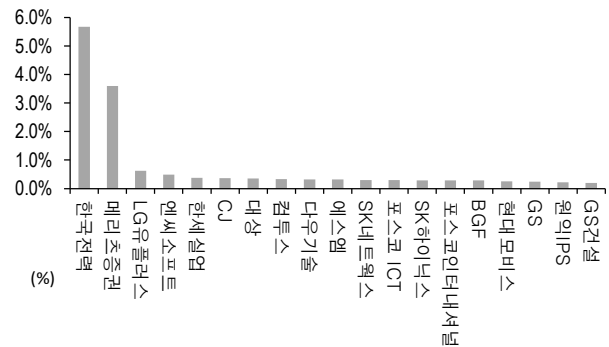
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	2,470,956	2,334.8	5,725,469	227,787	446	173,886	-179,543	2.4	128.7	-136.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	361,000	-0.28	147.4	80.2	18,698	739	0.06%	-1,339	803	490	-1,677	1,038
삼성전자	80,300	1.13	728.4	75.0	1,788,662	112,514	-0.01%	-1,277	88,262	-91,765	-125,144	2,982
현대제철	41,850	0.24	8.7	68.3	30,409	-2,641	-0.77%	2,055	687	-2,752	1,111	536
SK 이노베이션	222,000	2.78	58.0	66.9	23,272	1,471	-0.72%	921	-53	-918	-2,312	-198
SK 하이닉스	128,000	1.19	205.6	65.1	290,421	25,070	0.29%	-3,542	2,557	753	-18,309	-3,000
LG 전자	136,000	0.00	90.8	57.1	44,961	-5,607	-0.11%	-1,194	-935	2,229	4,445	1,246
삼성 SDI	651,000	1.72	71.0	51.0	33,647	-1,036	-0.03%	-290	-930	1,213	40	1,228
NAVER	384,000	1.99	80.5	50.7	34,252	519	0.05%	316	3,086	-3,512	-2,518	-994
엔씨소프트	652,000	0.31	28.8	49.8	15,532	145	0.49%	-3	176	-173	-545	72
삼성전기	195,500	6.25	181.8	42.3	50,904	19,283	0.12%	706	3,214	-4,403	-16,071	-1,685

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터