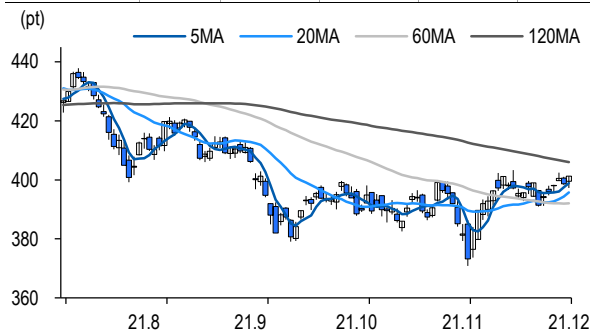


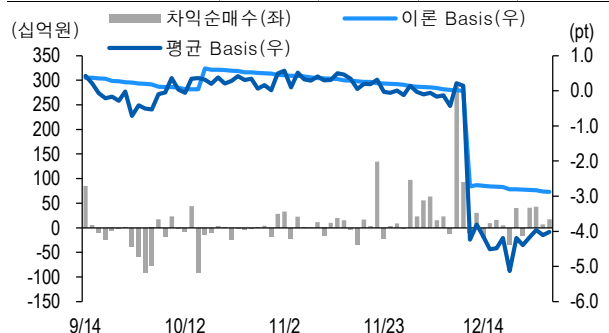
선물옵션시장 지표

2021.12.29

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	401.21	0.65	2.60	9,174.4	-
선물 3월물	398.30	1.01	4.00	19,595.3	242,197
선물 6월물	398.40	0.92	3.65	20.8	10,261
1월물(mini)	397.50	0.99	3.90	2,005.4	72,705
2월물(mini)	397.20	0.81	3.20	6.4	5,769



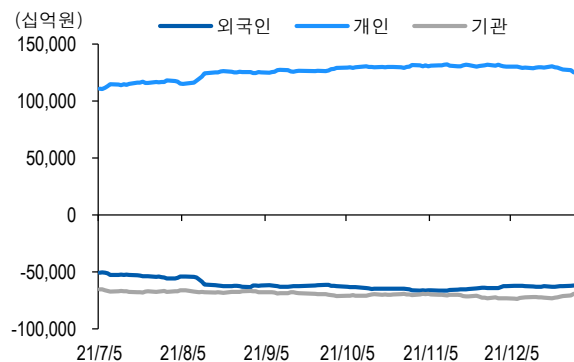
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	-2.88	-4.02	-2.91	-0.28%
베이스(mini)	-3.66	-4.74	-3.71	-0.27%
제1스프레드(SP)	0.64	0.21	0.20	-0.11%
합성선물 베이스(ATM)	-3.66	-3.78	-3.78	-0.03%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	439.1	-29.4	409.7	0.0	387.2	-88.7	-156.6	-8.1	1.5	33.2
개인	-1,975.9	156.8	-1,819.2	0.0	-33.8	-77.9	-47.6	4.8	1.1	81.7
기관	1,520.7	-108.2	1,412.6	17.4	156.2	197.5	192.9	3.1	-2.5	-114.9
금융투자	1,461.1	-135.2	1,326.0	2.5	41.4	-395.6	193.1	3.0	-2.4	-427.2
투신	4.8	33.8	38.6	2.0	46.9	584.3	-0.3	0.0	0.0	336.2
은행+보험+기타금융	32.3	-31.9	0.4	11.3	31.2	-4.7	0.1	0.1	-0.1	-6.9
연기금+국가자재	-3.9	10.1	6.3	-0.1	18.6	13.5	0.0	0.0	0.0	-17.0
기타법인	16.1	-19.2	-3.1	0.0	-2.7	-30.9	11.3	0.2	-0.1	0.0

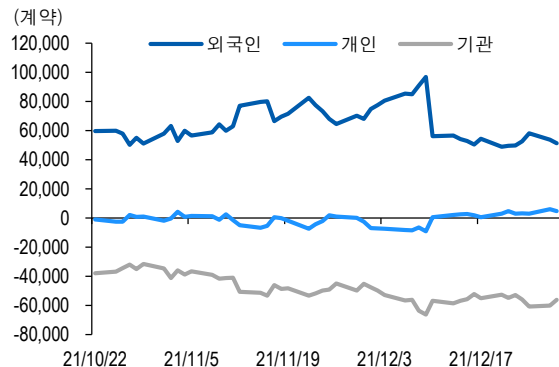
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



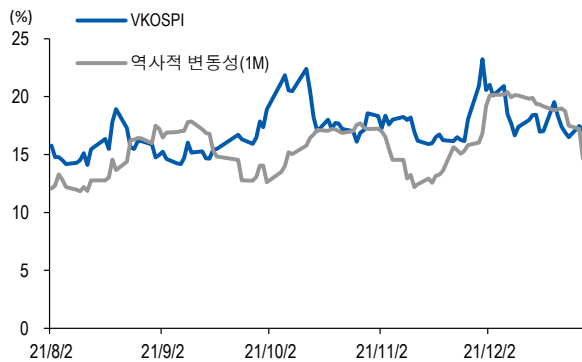
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	656,182	215.5	723,269	15.0%	지수옵션 전체	1,225,400	384.4	1,910,236
Put	569,218	168.9	1,186,967	16.4%	PCR(금액기준)	0.78	VKOSPI	17.07%(-0.39%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	405.0(K+3)	2.25	0.80	87,104	27,162	237	14.9	Put	400.0(K+1)	6.61	-2.52	929	6,104	139	15.5
	402.5(K+2)	3.00	1.01	58,274	15,299	155	14.8		397.5(K+0)	5.31	-2.19	3,920	3,885	374	15.6
	400.0(K+1)	4.10	1.40	64,313	29,248	8,334	15.2		395.0(K-1)	4.22	-1.89	6,930	7,334	1,725	15.8
	397.5(K+0)	5.24	1.65	17,254	9,669	263	15.2		392.5(K-2)	3.31	-1.60	8,859	5,864	794	16.1
	395.0(K-1)	6.72	2.04	10,975	11,498	1,206	15.7		390.0(K-3)	2.64	-1.29	21,397	9,931	338	16.6

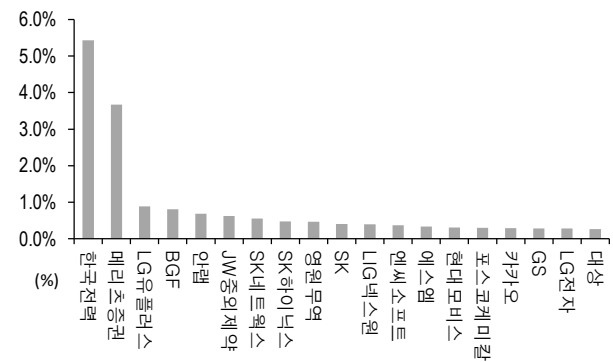
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,797,902	3,029.0	6,521,855	530,446	53,288	101,587	-156,954	33.2	81.7	-114.9	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	360,000	1.12	220.7	113.4	23,930	3,836	0.11%	-32	1,804	-1,748	-5,047	1,208
SK 하이닉스	126,500	0.40	371.6	72.4	376,983	61,460	0.48%	9,467	9,441	-18,517	-62,444	132
삼성전자	80,100	0.38	918.0	63.6	2,095,612	239,138	0.03%	-30,799	-4,634	33,954	-192,081	-21,976
만도	63,300	1.28	8.4	45.5	15,103	2,983	-0.38%	-161	410	-249	-3,739	696
삼성전기	193,000	-0.26	71.1	44.7	58,161	4,082	0.08%	-824	1,289	-467	-2,653	-755
아모레퍼시픽	175,500	1.15	9.9	42.7	9,711	-379	-0.14%	-109	81	28	-162	518
현대제철	41,100	0.12	8.0	42.0	22,944	-5,210	-1.03%	2,348	606	-2,954	815	1,600
NAVER	383,500	0.79	88.2	42.0	36,938	2,519	0.03%	462	903	-1,369	-669	-505
한국전력	22,550	5.13	84.5	40.8	183,106	13,926	5.43%	-4,390	-1,330	5,600	-3,946	-157
LG 전자	137,500	0.00	63.9	39.2	53,675	5,014	0.28%	2,364	-1,390	-674	-7,332	543

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터