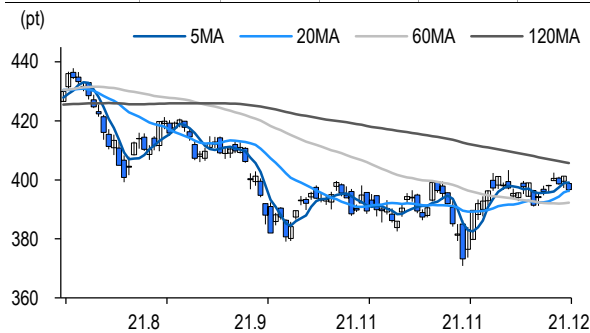


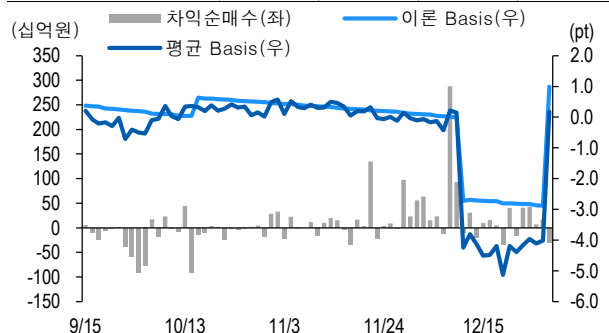
선물옵션시장 지표

2021.12.30

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	396.72	-1.12	-4.49	8,442.5	-
선물 3월물	396.30	-0.50	-2.00	20,913.2	238,724
선물 6월물	396.55	-0.46	-1.85	184.3	10,402
1월물(mini)	395.70	-0.45	-1.80	2,309.7	70,709
2월물(mini)	396.22	-0.25	-0.98	2.5	5,789



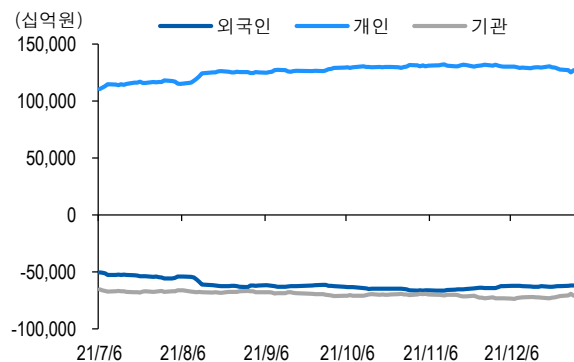
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.99	0.18	-0.42	-0.20%
베이스(mini)	0.21	-0.41	-1.02	-0.16%
제1스프레드(SP)	0.65	0.20	0.20	-0.11%
합성선물 베이스(ATM)	0.21	-1.00	-1.00	-0.30%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-122.3	36.7	-85.6	-8.3	-52.6	-136.2	87.9	9.5	-1.9	-107.6
개인	1,851.9	-83.5	1,768.4	0.0	31.0	109.1	50.3	-6.3	-0.4	-0.2
기관	-1,736.0	53.1	-1,682.9	-21.3	-24.1	16.7	-135.6	-3.0	2.3	108.2
금융투자	-1,494.2	48.9	-1,445.3	-13.0	-14.1	115.0	-136.0	-2.7	2.0	296.1
투신	28.8	65.6	94.3	0.0	48.5	-188.9	0.3	-0.1	0.0	-190.1
은행+보험+기타금융	-120.6	-70.7	-191.3	-0.5	-43.8	67.8	0.0	-0.1	0.3	-0.2
연기금+국가지자체	-88.1	0.2	-87.9	-7.8	-7.5	22.8	0.0	0.0	0.0	2.4
기타법인	6.4	-6.2	0.2	0.0	-0.4	10.4	-2.6	-0.3	0.0	-0.5

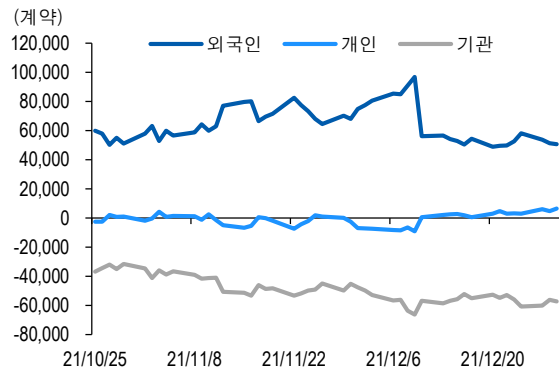
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



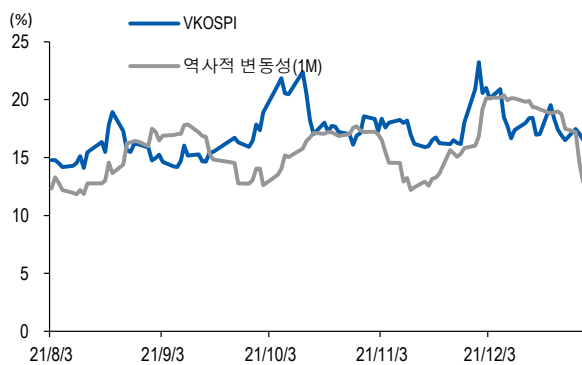
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	693,070	232.4	757,454	13.3%	지수옵션 전체	1,388,989	463.6	1,986,463
Put	695,919	231.1	1,229,009	16.7%	PCR(금액기준)	0.99	VKOSPI	16.55%(-0.52%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	407.5(K+3)	1.07	-0.62	79,418	21,059	105	13.4	Put	402.5(K+1)	8.70	0.09	489	725	36	16.4
	405.0(K+2)	1.55	-0.70	76,809	27,767	605	13.4		400.0(K+0)	7.28	0.67	3,858	6,082	-22	16.9
	402.5(K+1)	2.18	-0.82	40,099	15,313	14	13.2		397.5(K-1)	5.81	0.50	7,566	4,914	1,029	16.7
	400.0(K+0)	3.00	-1.10	38,502	22,540	-6,708	13.1		395.0(K-2)	4.56	0.34	15,912	7,998	664	16.6
	397.5(K-1)	4.04	-1.20	10,559	10,657	988	13.0		392.5(K-3)	3.55	0.24	25,723	7,026	1,162	16.7

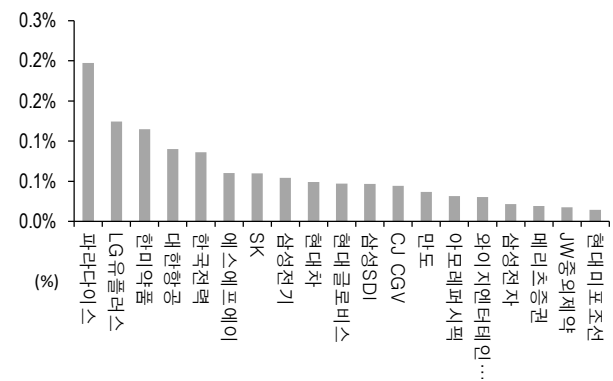
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,453,462	3,702.3	6,194,092	-327,763	-158,940	-21,525	183,860	-107.6	-0.2	108.2	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
SK 하이닉스	127,500	0.79	492.8	101.3	353,700	-23,283	-0.09%	-13,144	-5,088	18,007	33,675	-208
LG 이노텍	368,000	2.22	159.3	88.9	23,654	-276	-0.03%	1,756	-1,532	-232	745	-1,064
삼성전자	79,000	-1.37	1,319.2	84.1	1,940,517	-155,095	0.02%	-34,745	59,854	-25,898	157,707	9,172
POSCO	279,000	2.57	62.4	68.2	27,220	-4,978	-0.06%	-343	-4,326	4,714	5,616	-887
현대차	212,500	0.47	93.5	66.6	73,838	-4,314	0.05%	-1,313	-3,710	5,043	2,168	2,875
SK 이노베이션	240,000	6.67	95.9	60.4	41,201	11,727	0.01%	1,200	-239	-926	-4,429	-3,237
LG 전자	141,000	2.55	90.7	58.7	60,495	6,820	-0.03%	1,867	4,011	-5,726	-4,268	-3,242
NAVER	383,000	-0.13	78.1	57.7	37,959	1,021	-0.04%	-1,852	2,579	-723	-1,141	418
삼성전기	197,500	2.33	96.4	57.4	54,630	-3,531	0.05%	-1,815	-4,453	6,313	3,040	1,363
LG 화학	629,000	1.62	57.6	56.7	15,007	2	-0.07%	44	24	-47	504	-209

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터