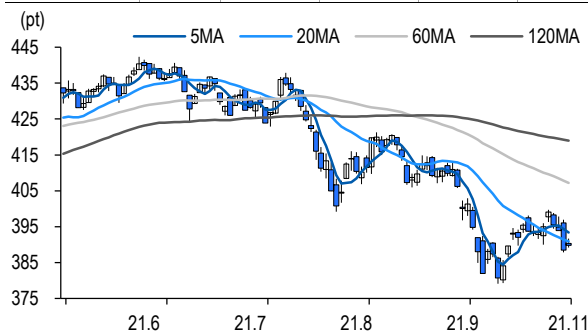


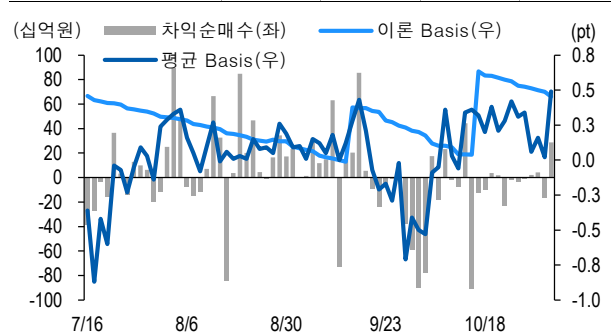
## 선물옵션시장 지표

2021.11.2

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	389.81	0.34	1.34	6,539.9	-
선물 12월물	390.90	0.71	2.75	19,511.6	272,340
선물 3월물	386.75	0.59	2.25	13.1	11,821
11월물(mini)	390.52	0.64	2.48	1,917.1	74,730
12월물(mini)	390.64	0.64	2.24	10.3	9,012



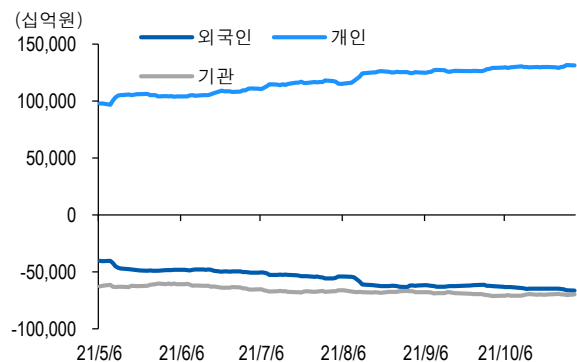
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.45	0.49	1.09	0.01%
베이스(mini)	0.12	0.21	0.71	0.02%
제1스프레드(SP)	-2.89	-3.83	-3.80	-0.24%
합성선물 베이스(ATM)	0.12	0.75	0.75	0.16%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-358.5	2.2	-356.4	0.0	-379.8	991.0	-320.6	-2.2	3.4	35.2
개인	-265.9	18.4	-247.5	0.0	16.6	-300.2	10.9	-2.0	0.5	-84.4
기관	636.8	-25.6	611.2	28.7	-15.3	-624.6	309.6	4.2	-3.9	49.1
금융투자	764.3	-5.8	758.5	5.6	3.4	-920.3	310.0	4.0	-2.9	51.0
투신	-33.2	2.1	-31.1	0.0	3.5	354.5	-0.5	0.0	0.1	5.6
은행+보험+기타금융	-8.4	-8.6	-17.0	0.0	-0.5	-50.2	0.1	0.2	-1.1	-0.2
연기금+국가자재	-65.2	0.7	-64.6	17.3	-27.3	-8.6	0.1	0.0	0.0	-7.2
기타법인	-12.4	5.0	-7.4	0.0	0.9	-66.2	0.1	0.0	0.0	0.0

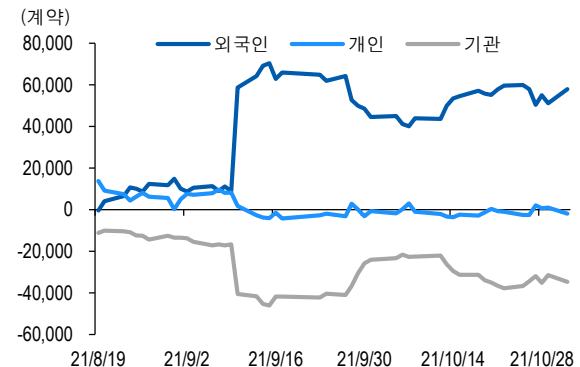
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이



## 선물옵션시장 지표

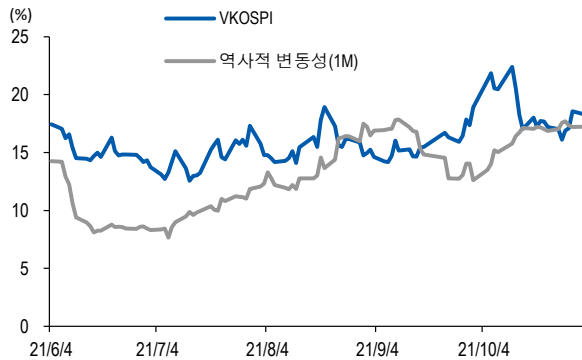
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	606,711	171.9	795,200	16.7%	지수옵션 전체	1,275,941	346.1	2,067,146
Put	669,230	174.2	1,271,946	18.3%	PCR(금액기준)	1.01	VKOSPI	18.33%(-0.22%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	395.0(K+3)	2.46	0.26	56,075	14,243	813	16.7	Put	390.0(K+1)	4.35	-1.76	13,796	28,554	278	16.0
	392.5(K+2)	3.52	0.41	27,335	7,902	1,012	17.3		387.5(K+0)	3.42	-1.53	18,369	10,989	420	16.9
	390.0(K+1)	4.87	0.67	12,601	9,198	2,018	18.1		385.0(K-1)	2.65	-1.27	36,002	19,103	1,231	17.6
	387.5(K+0)	6.48	0.98	2,833	3,447	502	19.2		382.5(K-2)	2.04	-1.12	41,648	14,364	204	18.3
	385.0(K-1)	8.18	0.87	1,260	3,194	223	20.0		380.0(K-3)	1.56	-0.94	61,730	26,424	71	18.9

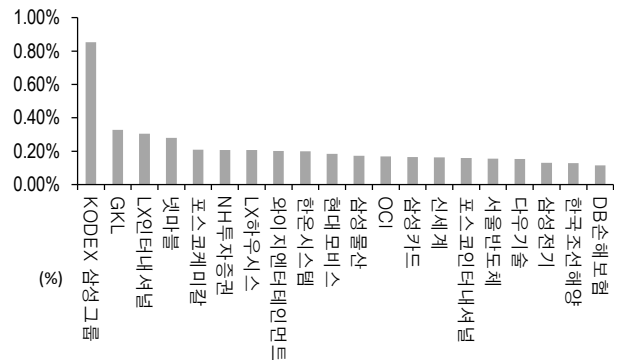
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 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	2,851,410	2,195.2	5,492,323	-14,531	44,408	-76,128	31,393	35.2	-84.4	49.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
기아	84,100	-0.71	54.6	70.5	54,837	-6,500	-0.08%	373	-9,222	8,849	6,031	8,358
삼성 SDI	721,000	-1.77	111.3	60.3	26,229	-1,335	-0.03%	679	-1,773	1,098	957	136
NAVER	407,500	0.25	80.5	58.6	58,645	-4,164	-0.02%	-624	-1,672	2,314	1,424	890
영진약품	4,760	2.59	0.7	57.3	8,701	1,744	-0.02%	623	9	-630	-619	-11
현대차	207,000	-0.48	46.7	57.0	46,966	-1,343	0.01%	413	-2,889	2,476	2,088	688
삼성전자	70,100	0.57	452.6	56.4	1,177,321	-19,895	0.01%	-3,613	-10,951	14,564	14,835	-418
현대모비스	253,000	0.20	29.4	56.0	12,617	-38	0.18%	617	-257	-360	-769	-791
넷마블	127,500	3.24	12.8	55.8	8,993	-1,397	0.28%	2,044	191	-2,235	-3,495	-659
GS 건설	42,050	2.06	8.0	55.0	39,760	-884	0.01%	-1,421	88	1,333	95	1,239
LG 화학	832,000	-0.72	96.1	52.4	10,598	-47	0.00%	0	-39	39	191	-152

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터