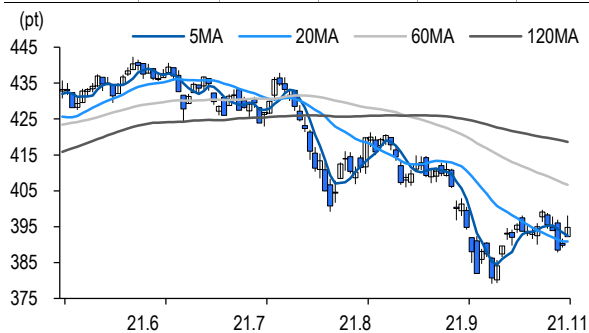


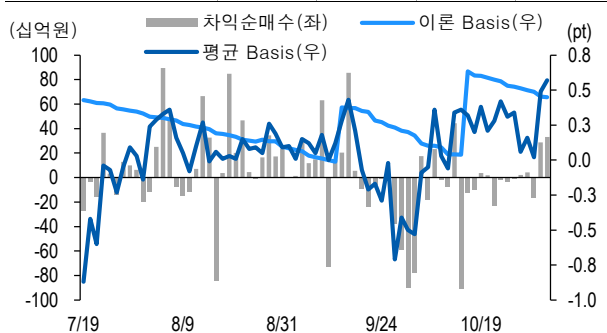
## 선물옵션시장 지표

2021.11.3

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	394.82	1.29	5.01	6,936.1	-
선물 12월물	395.60	1.20	4.70	25,471.0	275,828
선물 3월물	391.50	1.23	4.75	74.7	11,944
11월물(mini)	395.28	1.22	4.76	2,684.3	83,697
12월물(mini)	395.52	1.18	4.88	23.1	17,279



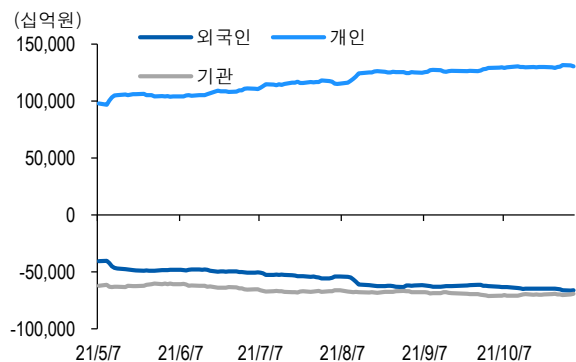
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.45	0.57	0.78	0.03%
베이스스(mini)	0.11	0.26	0.46	0.04%
제1스프레드(SP)	-2.87	-3.93	-3.95	-0.27%
합성선물 베이스스(ATM)	0.11	0.45	0.45	0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	317.3	-30.3	287.0	16.9	135.0	757.7	-248.6	-5.5	2.2	-16.4
개인	-1,075.8	106.7	-969.2	0.0	1.3	207.9	-44.0	3.1	-3.1	5.5
기관	765.3	-76.3	689.0	16.2	-64.4	-945.8	302.3	2.2	1.3	13.1
금융투자	856.7	-100.7	756.1	8.3	6.5	-1,118.8	305.4	1.5	1.2	17.4
투신	-6.9	5.6	-1.3	0.0	-1.6	214.7	-3.0	0.0	0.1	4.4
은행+보험+기타금융	-68.9	23.5	-45.3	0.0	-64.3	-15.7	0.0	0.7	0.1	0.6
연기금+국가자재	-31.9	2.3	-29.6	7.9	-8.3	-26.1	-0.1	0.0	0.0	-9.3
기타법인	-6.8	-0.1	-6.9	0.0	0.3	-19.7	-9.7	0.2	-0.3	-2.2

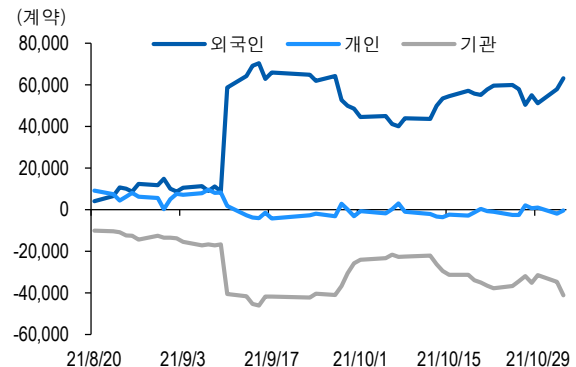
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 투자주체별 선물 누적 순매수 추이

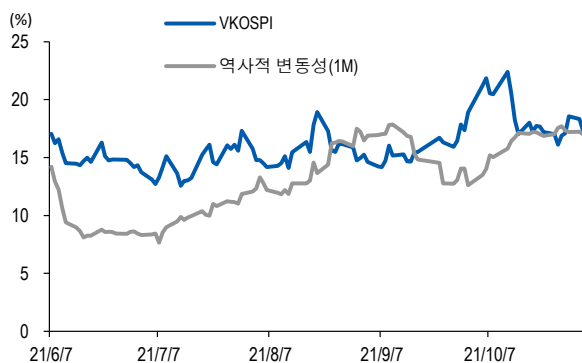


## 선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향													(계약, 십억원)			
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정		
Call	1,030,394		325.6		800,582		15.4%		지수옵션 전체	2,158,403		547.2		2,087,752		
Put	1,128,009		221.7		1,287,170		17.0%		PCR(금액기준)	0.68		VKOSPI		17.28%(−1.05%p)		
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	
Call	397.5(K+3)	2.90	1.28	61,927	14,443	1,942	15.5	Put	392.5(K+1)	2.91	−2.60	40,514	8,872	792	15.4	
	395.0(K+2)	4.16	1.70	27,406	15,833	1,590	16.1		390.0(K+0)	2.17	−2.18	70,384	29,378	824	16.2	
	392.5(K+1)	5.68	2.16	7,859	6,930	−972	16.7		387.5(K−1)	1.58	−1.84	73,165	16,160	5,171	16.7	
	390.0(K+0)	7.44	2.57	11,016	10,147	949	17.6		385.0(K−2)	1.17	−1.48	89,410	21,461	2,358	17.5	
	387.5(K−1)	9.25	2.77	1,260	3,401	−46	17.8		382.5(K−3)	0.85	−1.19	61,508	14,117	−247	18.1	

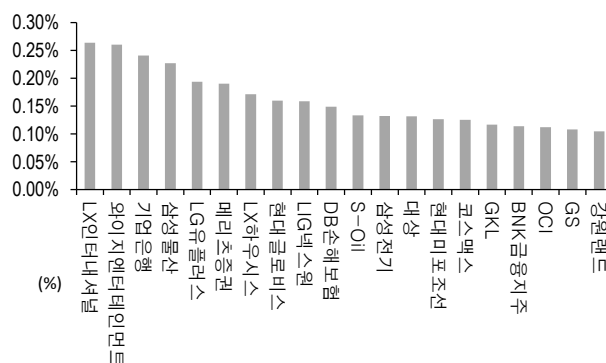
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

## 주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	3,495,426	2,657.9	5,695,174	202,851	6,321	52,118	-57,825	-16.4	5.5	13.1

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성 SDI	732,000	1.53	121.6	75.8	22,680	-3,549	-0.10%	-159	-2,686	2,859	2,333	431
삼성전자	71,600	2.14	872.1	73.7	1,191,000	13,679	0.03%	-17,115	25,360	-5,208	6,132	-18,740
GS 건설	42,900	2.02	12.7	70.6	44,894	5,134	0.04%	266	4,106	-4,472	-976	-4,656
현대차	210,000	1.45	53.7	61.3	48,739	1,773	0.08%	-624	1,919	-1,305	-28	-1,277
LG 화학	828,000	-0.48	72.9	61.2	10,200	-398	0.00%	-260	-117	402	125	271
한세실업	23,150	0.87	2.7	60.7	7,577	-1,613	-0.03%	173	-387	214	191	23
와이지엔터	72,900	3.11	19.2	59.9	36,006	5,210	0.26%	366	-1,543	1,177	-5,719	0
NAVER	409,500	0.49	85.7	59.7	48,959	-9,686	0.01%	-548	-493	1,006	1,186	-130
SK 하이닉스	108,000	0.93	174.7	56.2	111,256	1,721	-0.05%	-8,733	-1,209	9,975	2,668	500
현대제철	44,100	0.11	13.5	55.9	16,194	-514	0.02%	625	-171	-464	-160	-304

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터