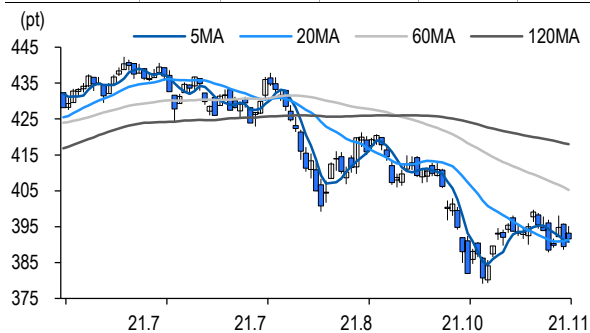


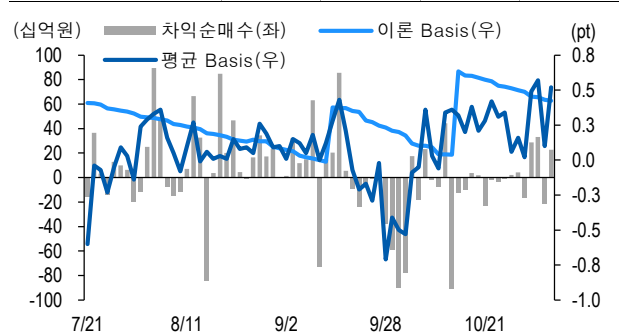
선물옵션시장 지표

2021.11.5

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	391.54	0.53	2.06	10,176.5	-
선물 12월물	392.45	0.87	3.40	25,990.7	271,096
선물 3월물	388.45	0.82	3.15	41.0	12,070
11월물(mini)	392.18	0.84	3.28	2,409.1	96,274
12월물(mini)	392.60	0.91	3.34	15.8	18,390



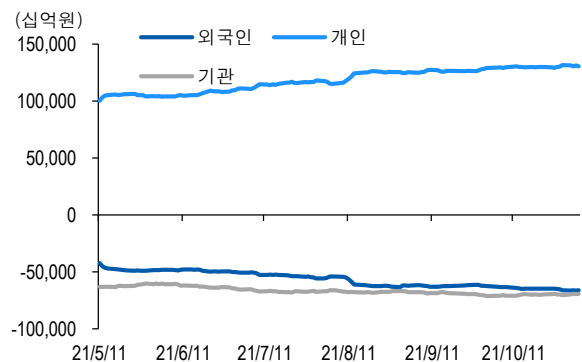
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.42	0.52	0.91	0.02%
베이스(mini)	0.08	0.20	0.64	0.03%
제1스프레드(SP)	-2.88	-3.95	-3.95	-0.27%
합성선물 베이스(ATM)	0.08	0.60	0.60	0.13%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	327.6	-25.2	302.4	0.0	146.7	801.0	-110.0	-2.0	4.0	30.0
개인	-658.6	-15.4	-674.0	0.0	1.6	-351.0	5.0	1.0	0.0	-29.0
기관	318.7	34.5	353.2	22.7	-77.9	-380.0	106.0	2.0	-3.0	-2.0
금융투자	460.9	-7.7	453.2	2.0	3.9	-651.0	106.0	2.0	-3.0	-13.0
투신	-46.6	9.3	-37.3	0.0	-4.2	285.0	0.0	0.0	0.0	27.0
은행+보험+기타금융	-10.0	42.6	32.5	0.0	-24.5	10.0	0.0	0.0	0.0	0.0
연기금+국가자재	-123.4	-1.1	-124.5	13.4	-62.3	-24.0	0.0	0.0	0.0	-15.0
기타법인	12.2	6.1	18.4	0.0	-1.2	-70.0	-1.0	0.0	-1.0	0.3

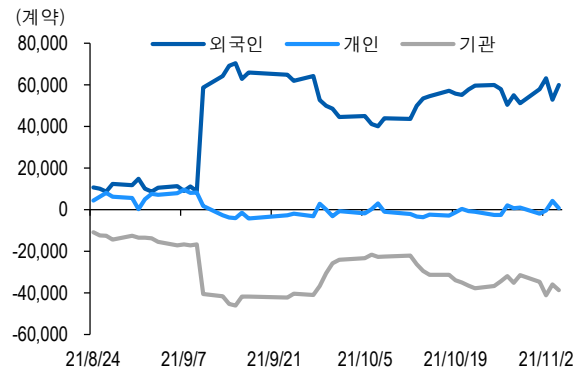
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



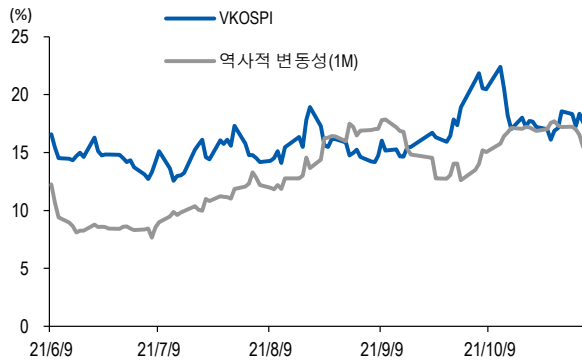
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,042,526	296.5	881,006	16.0%	지수옵션 전체	2,134,747	564.0	2,240,545
Put	1,092,221	267.5	1,359,539	16.8%	PCR(금액기준)	0.90	VKOSPI	17.60%(-0.76%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	397.5(K+3)	1.49	0.38	115,597	18,846	1,786	15.9	Put	392.5(K+1)	3.89	-2.25	33,534	11,782	2,022	14.9
	395.0(K+2)	2.36	0.63	82,403	18,659	1,007	16.4		390.0(K+0)	2.84	-1.94	79,674	29,690	2,013	15.6
	392.5(K+1)	3.53	0.94	27,153	12,033	1,818	17.0		387.5(K-1)	2.04	-1.54	93,267	17,503	2,904	16.3
	390.0(K+0)	4.98	1.27	12,282	14,557	1,211	17.8		385.0(K-2)	1.45	-1.28	100,678	23,229	1,151	17.0
	387.5(K-1)	6.68	1.70	3,364	3,991	267	18.7		382.5(K-3)	1.00	-1.02	116,974	15,544	1,046	17.6

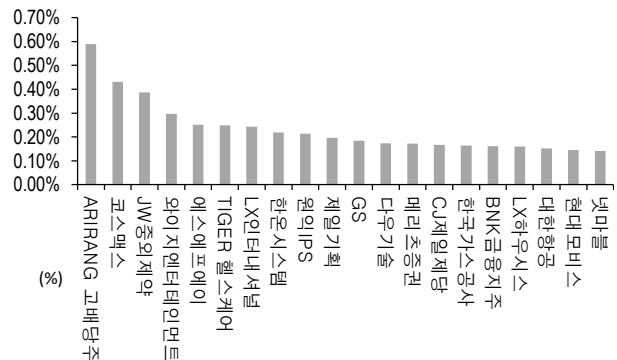
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	4,481,091	3,250.8	5,782,690	128,530	88,621	-35,482	-53,524	30.4	-29.2	-1.6	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	42,250	-0.94	17.9	88.6	27,837	-12,630	0.02%	2,077	-2,909	832	457	5,069
삼성전자	70,700	0.43	541.4	65.2	1,087,129	-79,358	0.05%	17,859	-25,332	8,149	14,252	-6,230
현대모비스	252,500	-0.20	38.8	63.9	13,437	100	0.15%	74	248	-328	222	-550
대한항공	30,400	0.66	24.3	63.7	136,600	17,958	0.15%	7,206	-388	-6,818	-9,603	-12,024
삼성전기	160,000	0.00	51.4	57.8	21,752	-2,273	-0.19%	-2,669	-9	2,690	6,506	881
SK 하이닉스	106,000	-0.47	117.4	53.4	102,138	-3,622	0.06%	1,894	3,962	-5,908	-6,887	200
넥센타이어	7,650	1.59	0.5	53.3	5,370	1,216	-0.17%	871	659	-1,530	-1,530	0
LG 화학	793,000	1.15	114.0	53.1	9,659	-249	0.08%	126	775	-901	-115	-743
카카오	130,500	4.40	402.9	52.2	121,721	-1,775	0.07%	2,617	7,016	-9,787	-17,943	-6,843
NAVER	411,500	2.49	112.1	50.9	39,313	-1,864	0.00%	628	-943	175	-413	599

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터