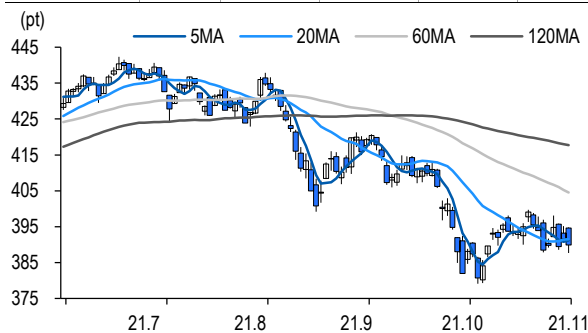


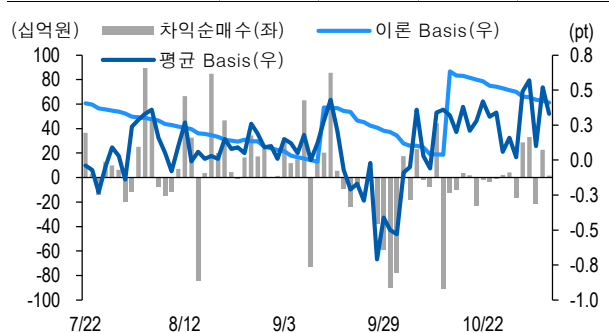
선물옵션시장 지표

2021.11.8

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	389.86	-0.43	-1.68	8,011.5	-
선물 12월물	390.65	-0.46	-1.80	26,067.7	272,032
선물 3월물	386.65	-0.46	-1.80	38.9	12,219
11월물(mini)	390.32	-0.47	-1.86	2,025.3	100,235
12월물(mini)	390.50	-0.50	-2.10	14.3	18,504



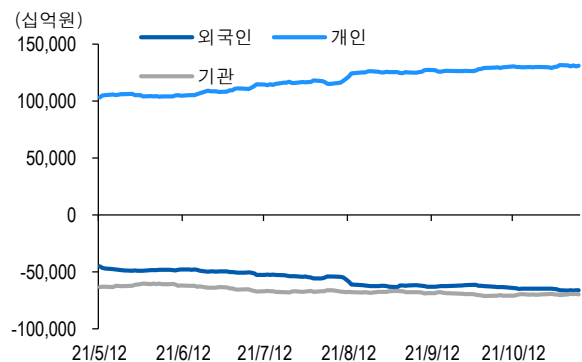
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.41	0.33	0.79	-0.02%
베이스(mini)	0.07	0.02	0.46	-0.01%
제1스프레드(SP)	-2.89	-3.96	-3.95	-0.27%
합성선물 베이스(ATM)	0.07	0.42	0.42	0.09%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	43.2	259.3	302.4	0.0	-11.1	-313.9	-14.5	0.5	8.2	20.1
개인	385.6	-1,059.6	-674.0	0.0	0.5	54.1	16.4	-0.1	1.1	-1.5
기관	-445.8	798.9	353.2	1.6	-109.6	212.4	-3.6	0.4	-8.9	-20.3
금융투자	-166.4	619.6	453.2	-1.3	0.7	254.7	-3.5	0.6	-9.0	-12.2
투신	-29.4	-8.0	-37.3	-1.0	11.0	-58.0	-0.1	-0.1	0.2	-0.3
은행+보험+기타금융	7.7	24.8	32.5	0.0	2.0	20.9	0.0	-0.1	0.0	-0.4
연기금+국가자재	-202.5	78.0	-124.5	3.9	-116.8	-5.1	0.0	0.0	0.0	-7.4
기타법인	17.0	1.4	18.4	0.0	0.5	47.3	1.6	-0.8	-0.4	1.7

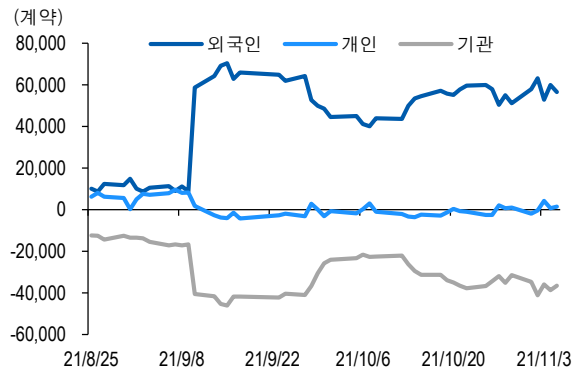
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

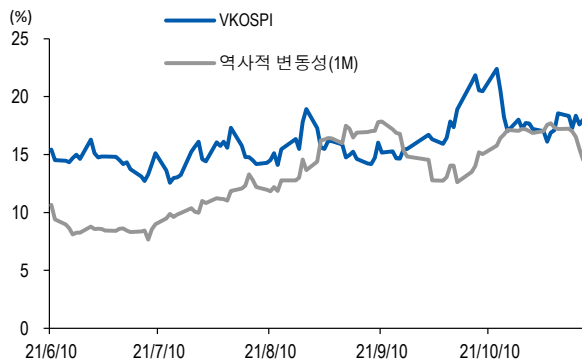


선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,531,192	330.9	929,975	16.1%	지수옵션 전체	3,453,957	823.7	2,340,791
Put	1,922,765	492.8	1,410,816	17.0%	PCR(금액기준)	1.49	VKOSPI	18.02%(+0.42%p)

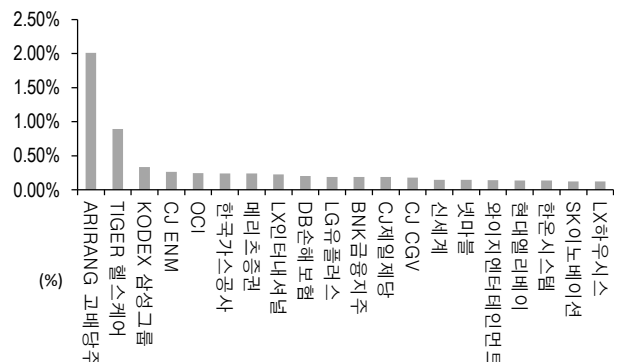
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	400.0(K+3)	0.51	-0.38	263,069	32,962	3,102	15.7	Put	395.0(K+1)	6.24	1.01	9,006	9,904	-503	14.2
	397.5(K+2)	0.93	-0.56	202,914	23,322	4,476	16.0		392.5(K+0)	4.73	0.84	18,213	12,158	376	15.3
	395.0(K+1)	1.58	-0.78	197,693	21,698	3,039	16.4		390.0(K-1)	3.46	0.62	57,997	29,096	-594	15.9
	392.5(K+0)	2.51	-1.02	140,854	13,828	1,795	16.9		387.5(K-2)	2.49	0.45	132,315	17,173	-330	16.7
	390.0(K-1)	3.73	-1.25	55,915	17,193	2,636	17.4		385.0(K-3)	1.74	0.29	173,702	24,720	1,491	17.3

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	3,726,952	2,848.1	5,806,092	23,402	-6,999	16,540	-9,479	20.1	-1.5	-20.3	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	41,650	-1.42	20.8	85.8	25,307	-2,530	0.01%	1,936	-3,096	1,130	3,037	-1,907
LG 화학	783,000	-1.26	110.5	81.6	8,930	-729	0.05%	-209	128	82	-543	536
삼성전자	70,600	-0.14	626.2	70.2	1,082,033	-5,096	0.06%	26,029	1,757	-27,887	-17,714	-10,765
NAVER	410,500	-0.24	87.3	69.1	39,283	-30	0.01%	599	-1,372	913	1,803	-895
카카오	129,000	-1.15	241.7	67.0	114,944	-6,777	-0.19%	1,498	-3,758	2,314	987	1,703
삼성 SDI	753,000	0.27	85.2	59.8	20,358	-1,219	-0.05%	-248	347	-235	-221	-14
LG 디스플레이	20,250	-0.25	22.6	57.2	248,401	-36,002	0.01%	7,899	-91	-7,908	-3,831	-2,977
SK 하이닉스	106,500	0.47	152.7	56.8	99,235	-2,903	-0.04%	1,830	327	-2,159	-2,159	0
현대건설	50,400	-2.33	14.0	56.7	17,759	-273	0.03%	2,773	-1,140	-1,633	-1,333	-300
LG 이노텍	215,000	-0.69	17.2	56.1	7,049	191	0.05%	788	-101	-689	-82	-607

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터