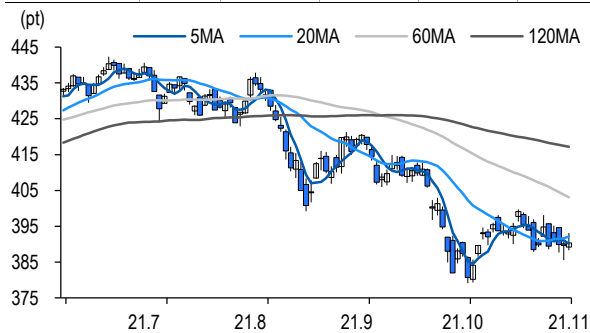


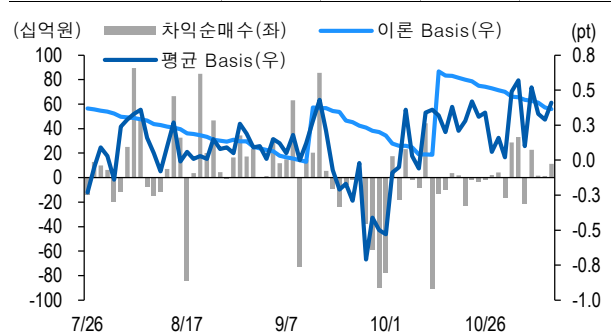
선물옵션시장 지표

2021.11.10

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	390.36	0.20	0.77	7,021.4	-
선물 12월물	390.50	0.14	0.55	26,018.3	271,193
선물 3월물	386.55	0.16	0.60	25.4	12,421
11월물(mini)	390.14	0.12	0.48	2,481.8	103,110
12월물(mini)	390.52	0.14	0.26	41.2	19,337



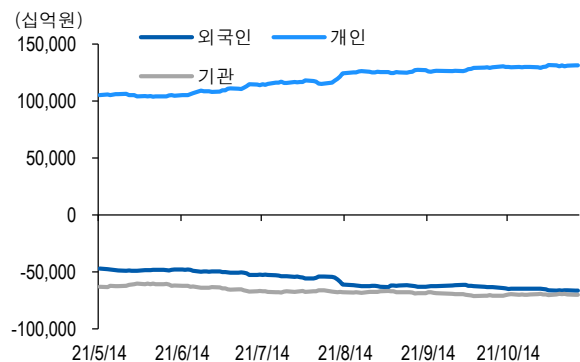
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.37	0.41	0.14	0.01%
베이스스(mini)	0.02	0.07	-0.22	0.01%
제1스프레드(SP)	-2.87	-3.94	-3.95	-0.27%
합성선물 베이스스(ATM)	0.02	-0.26	-0.26	-0.07%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	-137.7	21.0	-116.8	0.0	-204.1	492.0	45.0	-1.0	2.0	38.0
개인	-156.3	137.5	-18.8	0.0	-1.3	-186.0	-34.0	2.0	0.0	-18.0
기관	274.4	-161.5	112.8	11.2	-62.8	-248.0	-8.0	-1.0	-1.0	-21.0
금융투자	402.5	-61.1	341.4	1.1	5.8	-390.0	-8.0	0.0	0.0	-53.0
투신	-20.0	3.7	-16.2	0.0	-4.0	149.0	0.0	0.0	0.0	19.0
은행+보험+기타금융	7.0	-107.7	-100.7	-0.6	-2.3	2.0	0.0	-1.0	-1.0	0.0
연기금+국가자재	-109.0	-1.4	-110.4	7.8	-59.3	-9.0	0.0	0.0	0.0	14.0
기타법인	19.6	3.0	22.7	0.0	-0.6	-58.0	-3.0	0.0	-1.0	1.0

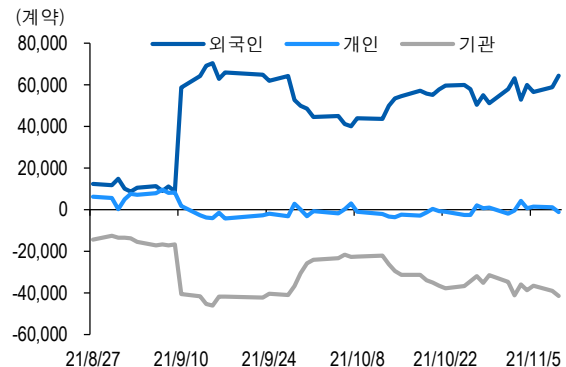
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



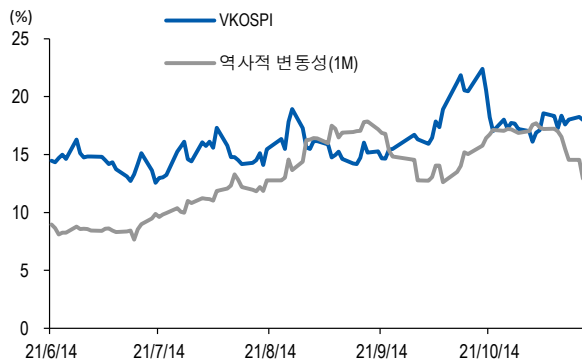
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	1,817,319	341.8	1,005,930	16.1%	지수옵션 전체	3,723,838	707.9	2,509,124
Put	1,906,519	366.1	1,503,194	19.5%	PCR(금액기준)	1.07	VKOSPI	18.00%(-0.24%p)

	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	397.5(K+3)	0.29	-0.25	313,759	28,691	4,288	16.0	Put	392.5(K+1)	3.80	-0.78	25,856	12,416	663	18.5
	395.0(K+2)	0.68	-0.33	335,438	29,571	4,216	16.1		390.0(K+0)	2.40	-0.76	109,142	28,006	200	18.4
	392.5(K+1)	1.40	-0.36	236,838	19,386	1,995	16.2		387.5(K-1)	1.44	-0.66	191,943	18,070	1,604	18.8
	390.0(K+0)	2.50	-0.35	132,131	22,039	2,031	16.3		385.0(K-2)	0.82	-0.52	283,030	27,671	2,430	19.3
	387.5(K-1)	4.05	-0.21	22,222	7,566	-92	16.5		382.5(K-3)	0.45	-0.37	268,658	21,469	3,292	19.9

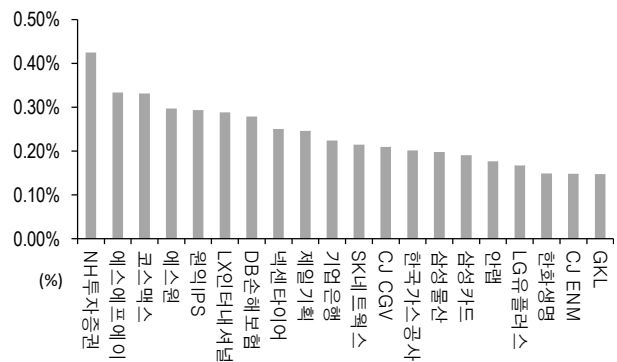
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,973,572	3,009.0	5,837,888	-37,808	-9,417	-52,202	61,102	37.9	-18.3	-20.6	

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
GS 건설	42,200	-0.12	13.8	97.0	15,907	-6,468	0.02%	-869	90	779	-726	1,505
삼성 SDI	748,000	0.40	107.4	92.5	10,205	-9,345	0.04%	138	2,269	-2,412	-1,776	-636
삼성전자	70,600	0.14	593.1	75.7	762,298	-155,441	0.06%	20,808	-14,784	-5,326	-1,055	-4,646
카카오	126,500	0.40	171.3	69.0	94,605	-7,989	0.14%	3,052	-1,618	-1,434	-3,533	-891
현대차	213,000	-1.16	86.2	65.6	40,118	-4,644	-0.05%	1,302	-3,577	2,275	1,039	1,236
하나금융지주	44,100	0.57	24.3	63.8	52,136	-27,956	-0.07%	-778	-3,232	4,010	-1,709	5,719
현대위아	78,800	-0.88	9.1	59.7	13,156	-4,585	0.07%	-2,276	5,586	-3,310	-2,885	-423
KT	30,900	0.82	7.8	57.4	46,449	-15,553	-0.17%	-6,846	8,063	-1,214	-1,259	45
대한항공	30,900	-0.80	25.3	55.8	132,208	-7,439	0.12%	38	-6,377	6,339	-1,879	5,877
현대모비스	248,500	-1.39	32.7	55.6	9,222	-2,968	0.10%	53	-1,423	1,370	318	1,065

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터