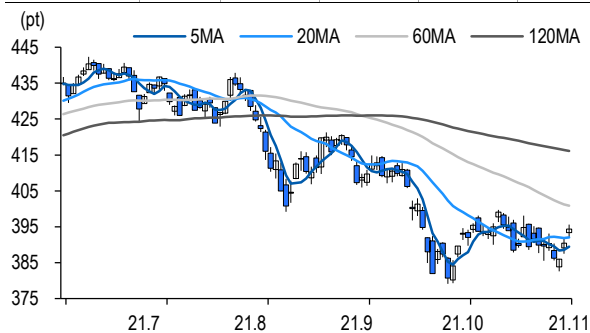


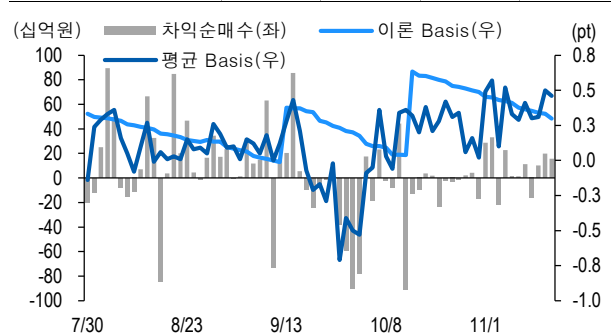
선물옵션시장 지표

2021.11.16

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	394.36	1.02	3.98	8,387.4	-
선물 12월물	395.30	1.06	4.15	16,730.9	283,677
선물 3월물	391.30	1.06	4.10	41.8	11,606
12월물(mini)	394.98	0.98	3.86	1,533.8	35,094
1월물(mini)	390.76	1.11	4.28	4.0	646



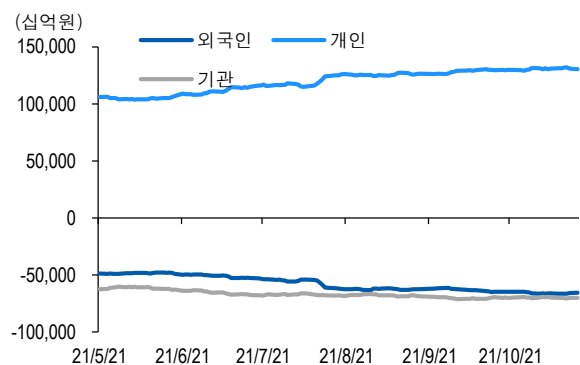
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.30	0.46	0.94	0.04%
베이스(mini)	0.30	0.45	0.62	0.04%
제1스프레드(SP)	-2.84	-3.92	-4.00	-0.27%
합성선물 베이스(ATM)	0.30	0.93	0.93	0.16%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	398.0	-44.0	354.0	0.1	289.6	185.3	75.8	-3.0	-0.9	-5.1
개인	-814.3	303.4	-510.9	0.0	-13.3	-114.4	-55.9	2.4	-1.8	18.3
기관	415.4	-268.4	147.0	15.5	-20.6	-49.6	-8.4	0.4	3.0	-19.4
금융투자	409.5	-269.4	140.1	19.5	-1.6	-156.1	-12.5	0.2	3.1	2.2
투신	-24.3	5.2	-19.1	0.0	-9.3	100.1	3.9	0.0	-0.1	20.6
은행+보험+기타금융	-3.2	-13.6	-16.8	-0.2	-7.0	7.8	0.2	0.2	0.0	1.3
연기금+국가자재	46.9	3.5	50.3	-3.8	3.8	-1.4	0.0	0.0	0.0	-43.4
기타법인	0.9	9.0	9.9	0.0	0.2	-21.4	-11.4	0.2	-0.3	6.1

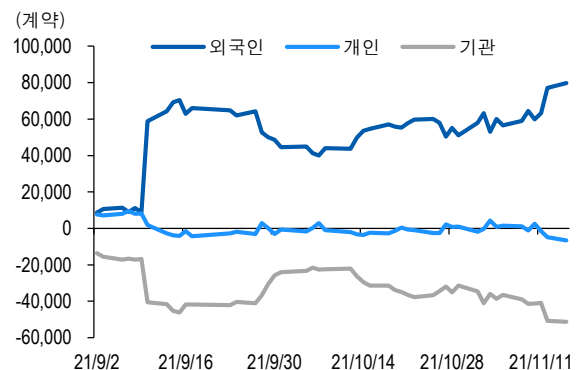
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이

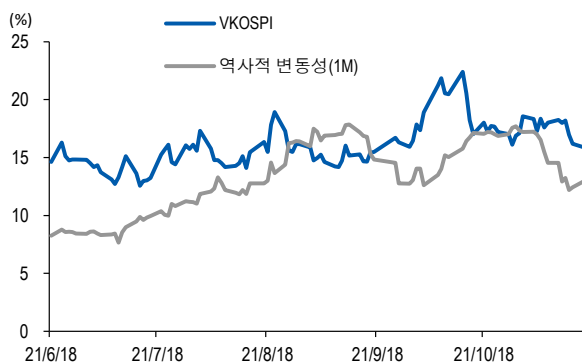


선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향													(계약, 십억원)		
	거래량		거래대금		미결제약정		대표변동성			거래량		거래대금		미결제약정	
Call	486,775		170.9		606,303		14.7%		지수옵션 전체	975,781		293.0		1,785,647	
Put	489,006		122.1		1,179,344		15.5%		PCR(금액기준)	0.71		VKOSPI		15.90%(−0.28%p)	
	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	397.5(K+3)	4.79	1.44	11,088	4,187	38	14.8	Put	392.5(K+1)	4.83	−2.13	3,737	2,175	723	14.2
	395.0(K+2)	6.04	1.69	7,984	8,738	139	15.1		390.0(K+0)	3.92	−1.89	8,989	14,130	702	14.6
	392.5(K+1)	7.57	2.03	2,721	3,696	−144	15.7		387.5(K−1)	3.23	−1.62	11,095	3,919	1,067	15.1
	390.0(K+0)	9.21	2.31	2,679	9,012	123	16.2		385.0(K−2)	2.58	−1.42	20,938	9,529	1,883	15.4
	387.5(K−1)	10.70	2.24	882	3,026	−11	15.9		382.5(K−3)	2.13	−1.17	18,258	4,351	1,756	16.0

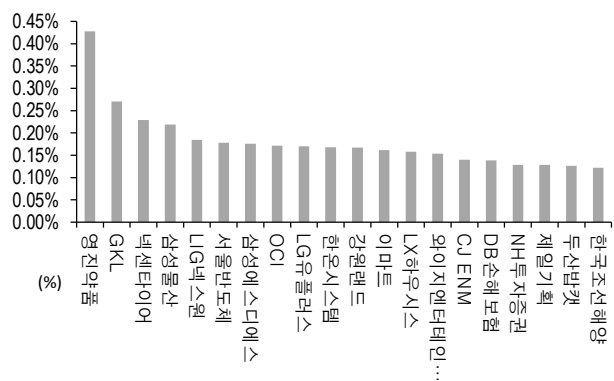
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	2,604,986	2,477.9	4,874,448	170,353	-28,663	41,739	-18,045	-5.1	18.3	-19.4

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
NAVER	409,500	0.12	81.9	60.2	45,311	-2,730	-0.15%	1,125	-6,937	5,894	5,351	430
현대차	209,000	0.48	45.7	58.3	38,158	1,869	0.05%	-586	645	-49	2,259	-2,308
기아	86,800	-0.12	57.2	56.9	51,316	1,105	0.00%	-1,866	2,341	-505	1,653	-2,136
삼성전자	71,600	1.42	501.6	56.7	1,234,256	46,482	0.09%	-6,938	15,655	-9,949	-2,109	-23,900
SK 머티리얼즈	389,600	-0.08	2.8	55.4	1,050	78	-0.04%	-4	86	-82	-78	0
SK	248,000	0.61	24.9	54.0	12,607	67	-0.05%	34	-874	840	512	388
LG 이노텍	256,500	5.99	75.9	45.6	9,673	255	-0.05%	206	-483	277	1,151	-729
현대모비스	247,500	1.64	23.0	45.0	8,063	751	0.07%	1,098	-227	-871	-210	-661
SK 하이닉스	110,500	3.76	230.8	44.4	104,362	12,086	0.06%	-657	2,450	-2,293	-5,005	-2,700
현대제철	41,800	0.60	6.1	44.3	18,682	1,397	0.00%	-723	-320	1,043	1,879	-836

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터