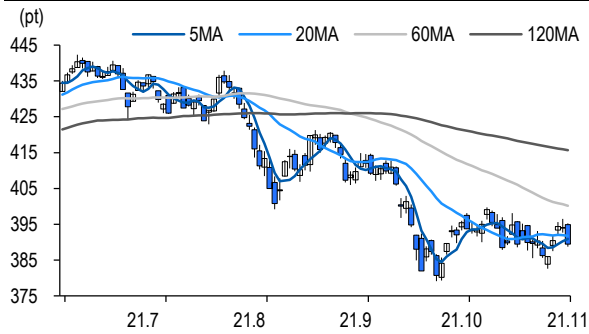


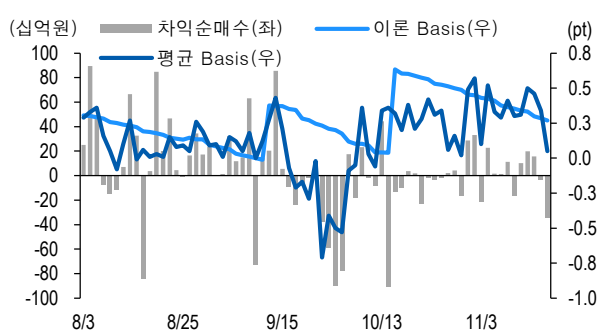
선물옵션시장 지표

2021.11.18

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	389.44	-1.17	-4.63	7,936.7	-
선물 12월물	389.85	-1.20	-4.75	19,624.3	283,986
선물 3월물	385.70	-1.23	-4.80	31.6	11,622
12월물(mini)	389.86	-1.20	-4.78	1,737.5	40,885
1월물(mini)	385.54	-1.22	-4.78	4.0	816

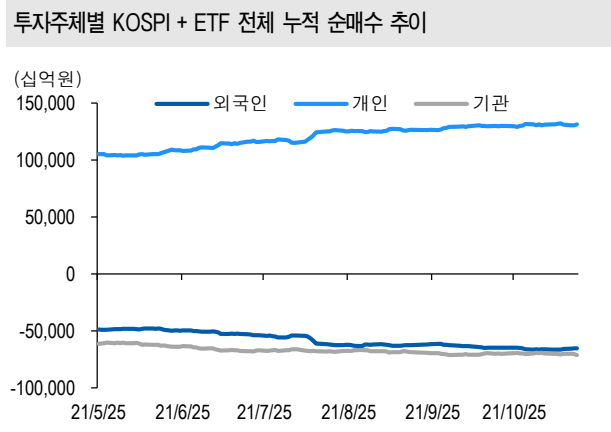


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.27	0.05	0.41	-0.06%
베이스스(mini)	0.27	0.05	0.42	-0.06%
제1스프레드(SP)	-2.86	-3.97	-3.95	-0.29%
합성선물 베이스스(ATM)	0.27	0.39	0.39	0.03%

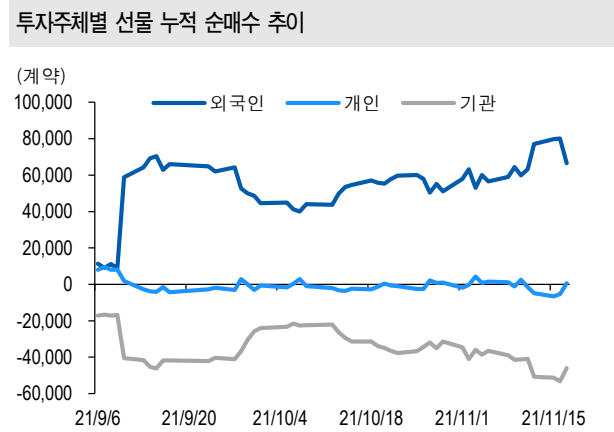


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	77.0	-40.1	36.9	0.0	65.4	-1,219.7	-117.5	-3.8	2.8	-4.9
개인	770.6	93.4	864.0	0.0	-11.5	458.7	115.6	1.2	-1.2	12.8
기관	-887.7	-54.7	-942.4	-34.4	-38.5	704.9	-6.0	2.8	-1.3	-6.8
금융투자	-639.5	-131.9	-771.4	-5.1	-4.7	802.8	-5.9	2.9	-1.2	-8.9
투신	-53.5	5.4	-48.1	0.0	-8.2	-138.8	-0.1	0.0	-0.1	-14.7
은행+보험+기타금융	-36.3	73.1	36.8	0.0	-41.6	13.3	0.0	-0.1	0.0	-0.1
연기금+국가자재	-100.1	-2.4	-102.5	-29.4	21.0	27.6	0.0	0.0	0.0	16.8
기타법인	40.0	1.5	41.5	0.0	-1.5	56.0	7.9	-0.2	-0.3	-1.1

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

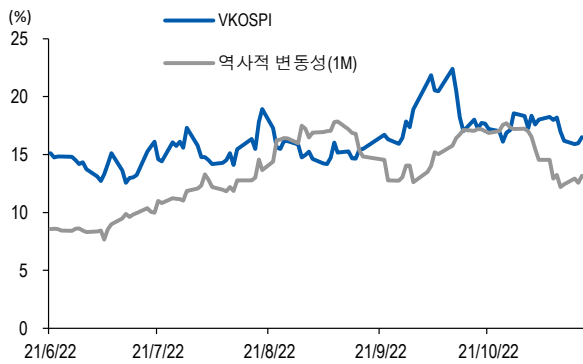
지수옵션 시장동향 (계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	495,942	145.9	667,651	14.1%	지수옵션 전체	1,044,561	351.3	1,936,467
Put	548,619	205.4	1,268,816	15.2%	PCR(금액기준)	1.41	VKOSPI	16.51%(+0.54%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	402.5(K+3)	1.35	-1.07	53,870	15,344	3,203	14.0	Put	397.5(K+1)	10.35	2.99	2,097	1,726	286	14.3
	400.0(K+2)	1.89	-1.39	49,813	20,979	4,650	14.1		395.0(K+0)	8.66	2.64	2,987	4,179	133	14.4
	397.5(K+1)	2.61	-1.73	21,069	6,662	1,560	14.4		392.5(K-1)	7.21	2.26	7,920	2,569	154	14.6
	395.0(K+0)	3.49	-2.07	15,617	9,773	547	14.6		390.0(K-2)	5.97	1.94	7,948	14,394	-334	14.9
	392.5(K-1)	4.56	-2.46	5,984	3,857	135	14.9		387.5(K-3)	4.91	1.63	11,859	5,276	350	15.3

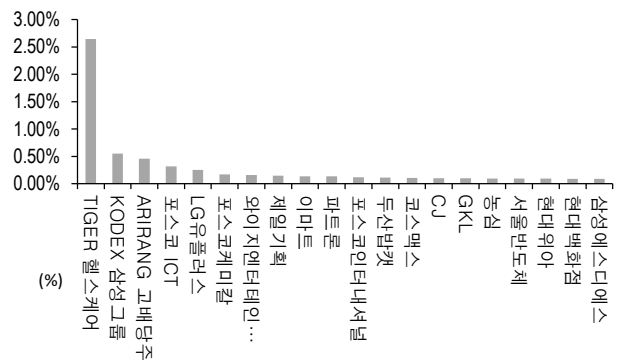
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이스스 괴리율



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현재배율 상위 10종목)

(계약, 십억원)

	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)
주식선물 전체	2,988,682	2,343.7	4,927,517	-24,223	-74,853	63,632	13,663	-4.9	12.8	-6.8

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현재배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	71,000	-0.70	507.6	65.5	1,158,858	-97,312	0.08%	10,100	-5,390	-1,471	-18,905	17,298
LG 이노텍	271,500	1.12	83.6	61.7	9,701	20	0.00%	1,862	-655	-1,205	259	-1,464
현대차	207,000	0.24	88.1	60.0	38,676	53	0.02%	1,679	188	-1,867	-2,566	699
SK 하이닉스	110,500	-1.34	197.0	58.2	94,247	-7,177	-0.12%	-1,953	-2,307	4,185	4,038	2,500
삼성 SDI	761,000	0.00	66.0	52.8	27,116	155	0.02%	533	350	-879	-463	-416
LG 화학	768,000	-1.41	51.2	50.3	8,406	-115	-0.07%	-203	108	79	284	-205
포스코케미칼	143,500	-2.05	21.3	48.9	16,750	4,559	0.17%	-2,503	6,163	-3,775	-1,574	-2,201
카카오	124,500	-1.97	102.4	48.8	103,368	-4,869	-0.19%	418	1,115	-1,533	2,811	2,825
한국금융지주	87,200	-2.79	8.4	48.7	26,710	-2,119	-0.03%	-1,342	-914	2,246	320	1,926
SK	254,000	0.59	57.6	45.9	11,319	347	-0.06%	556	-301	-205	-344	407

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터