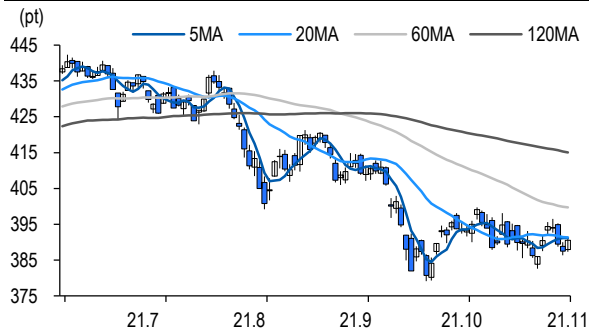


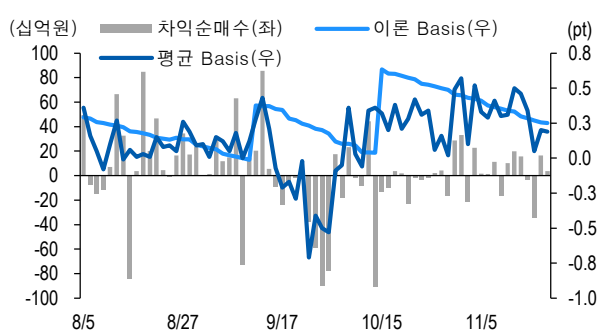
선물옵션시장 지표

2021.11.22

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	390.53	0.80	3.09	7,886.5	-
선물 12월물	390.85	0.64	2.50	22,011.6	281,300
선물 3월물	386.95	0.68	2.60	45.2	11,271
12월물(mini)	390.88	0.65	2.58	2,024.6	44,456
1월물(mini)	386.30	0.65	2.48	3.9	895

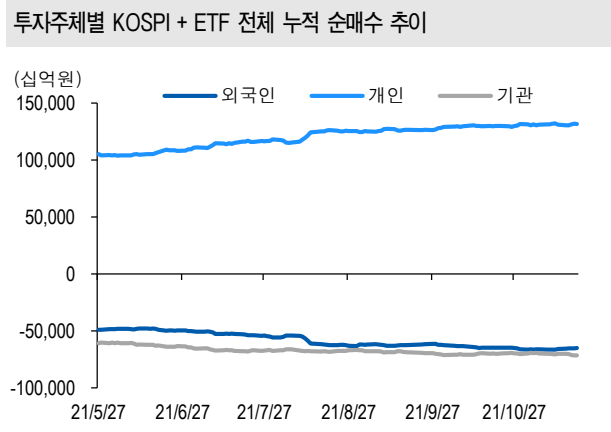


차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이스스	0.25	0.19	0.32	-0.02%
베이스스(mini)	0.25	0.19	0.35	-0.02%
제1스프레드(SP)	-2.86	-3.96	-3.95	-0.28%
합성선물 베이스스(ATM)	0.25	0.24	0.24	0.00%

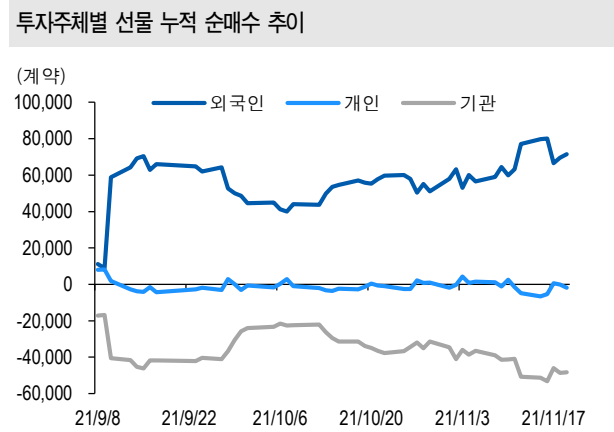


투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	231.1	6.5	237.6	-2.0	142.2	167.0	23.0	1.4	-3.8	-7.2
개인	-352.5	59.5	-293.1	0.0	-0.1	-143.8	-27.4	-1.7	2.9	38.3
기관	74.9	-68.2	6.7	5.7	-67.7	27.8	6.0	0.1	1.1	-29.9
금융투자	124.4	-149.5	-25.2	-0.2	-17.6	-277.0	6.6	0.1	1.1	-10.2
투신	-13.6	3.2	-10.4	0.0	-6.5	311.4	0.0	0.1	0.0	-0.9
은행+보험+기타금융	-14.1	69.0	54.9	0.0	-9.1	-2.4	-0.6	0.0	0.0	-0.2
연기금+국가자자체	-12.7	3.4	-9.3	5.9	-27.7	-4.2	0.0	0.0	0.0	-18.6
기타법인	46.5	2.3	48.7	0.0	0.5	-51.1	-1.6	0.1	-0.2	-1.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터



선물옵션시장 지표

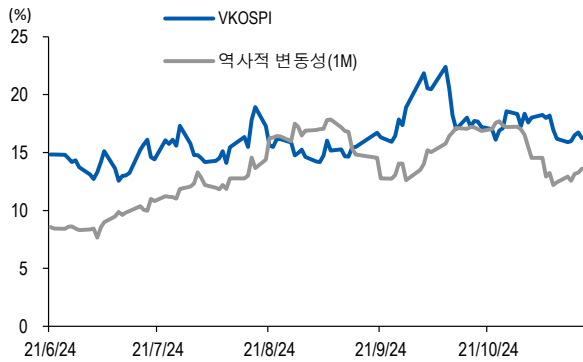
지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	638,353	208.4	711,733	14.1%	지수옵션 전체	1,189,842	382.5	2,036,745
Put	551,489	174.1	1,325,012	16.3%	PCR(금액기준)	0.84	VKOSPI	16.25%(-0.49%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	395.0(K+3)	3.48	0.62	52,071	11,682	857	14.2	Put	390.0(K+1)	5.15	-1.48	5,942	15,106	473	14.8
	392.5(K+2)	4.62	0.77	14,804	5,104	472	14.5		387.5(K+0)	4.20	-1.27	6,686	5,957	214	15.3
	390.0(K+1)	5.96	0.99	10,205	10,751	636	14.9		385.0(K-1)	3.37	-1.11	13,483	12,061	499	15.7
	387.5(K+0)	7.47	1.13	3,228	3,565	132	15.3		382.5(K-2)	2.70	-0.95	19,451	9,835	47	16.1
	385.0(K-1)	9.06	1.30	2,161	3,392	163	15.4		380.0(K-3)	2.17	-0.79	44,206	24,107	135	16.6

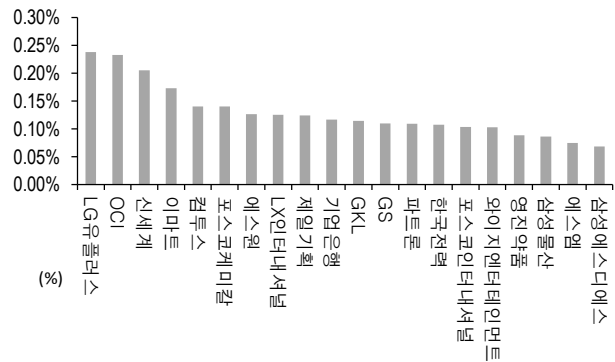
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

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	3,195,652	2,565.2	5,049,725	87,097	31,877	35,064	-62,989	-7.2	38.3	-29.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
LG 이노텍	289,000	1.05	91.3	76.2	8,747	-620	-0.04%	-942	618	324	620	-296
삼성전자	71,300	1.28	639.6	75.9	1,173,429	37,387	0.03%	-4,133	25,640	-21,413	-11,245	-11,444
삼성 SDI	754,000	-1.05	88.4	68.4	27,778	-307	0.00%	-937	846	91	-12	1,102
현대제철	40,450	0.50	13.2	64.2	19,521	-686	0.01%	1,358	1,351	-2,709	-2,435	-274
엔씨소프트	752,000	-1.18	119.0	54.9	11,083	329	-0.03%	311	-283	-31	157	-315
기아	84,100	1.33	63.1	54.0	54,021	130	0.02%	-1,172	-909	2,081	-1,065	2,805
SK	246,000	-0.40	20.1	49.4	11,917	456	0.01%	637	-32	-605	118	-723
POSCO	278,500	1.09	37.4	47.1	15,905	34	-0.03%	-31	-36	117	-239	356
한국항공우주	30,700	1.99	5.8	46.5	10,633	-5,594	0.00%	2,531	-796	-1,735	-6,545	-235
SK 하이닉스	112,000	1.82	119.5	46.3	93,912	-1,563	0.04%	-2,742	4,497	-1,705	-1,213	-900

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터