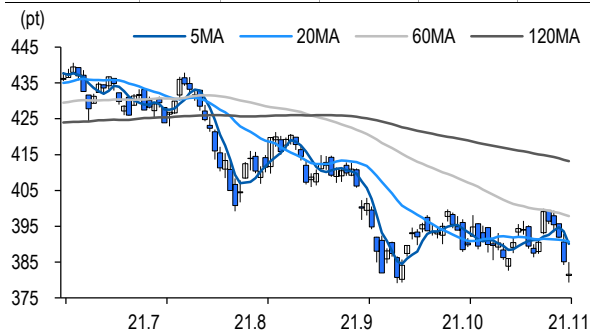


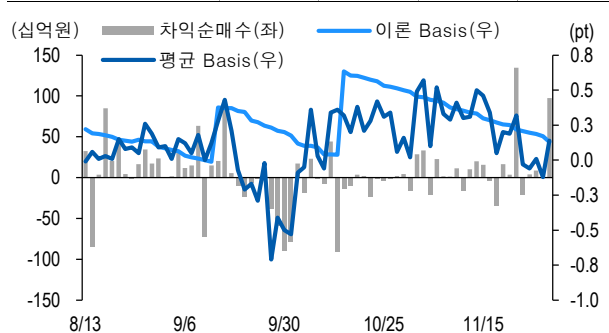
선물옵션시장 지표

2021.11.30

Market Data (십억원, 계약)					
	증가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	381.63	-0.89	-3.44	9,472.6	-
선물 12월물	381.95	-0.75	-2.90	28,520.2	288,919
선물 3월물	378.35	-0.66	-2.50	168.6	12,623
12월물(mini)	381.94	-0.76	-2.86	1,974.6	50,596
1월물(mini)	377.52	-0.82	-3.12	10.6	1,352



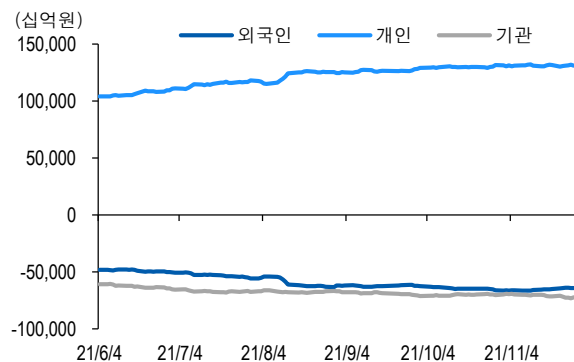
차익거래 관련 Market data (pt)				
	이론값	평균값	현재가	과리율(%)
K200 베이스	0.13	0.14	0.32	0.00%
베이스(mini)	0.13	0.14	0.31	0.00%
제1스프레드(SP)	-2.79	-3.90	-3.90	-0.29%
합성선물 베이스(ATM)	0.13	0.54	0.54	0.11%



투자주체별 매매 동향 (십억원)										
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	38.9	-34.0	4.9	-0.1	-30.7	504.7	35.9	-0.2	-1.6	29.7
개인	-761.2	20.2	-741.0	0.0	-2.1	-44.4	-36.8	-1.8	11.2	-102.0
기관	714.3	18.7	733.0	97.3	187.4	-464.6	0.7	2.3	-11.8	83.9
금융투자	705.6	-36.5	669.1	95.3	147.9	-563.5	1.1	2.9	-11.0	74.2
투신	47.0	11.5	58.5	-0.7	33.0	130.0	-0.5	-0.2	-0.4	-17.1
은행+보험+기타금융	-7.0	49.6	42.6	0.0	4.3	-26.8	0.0	-0.4	-0.3	-0.1
연기금+국가자재	-36.1	-5.1	-41.2	2.7	1.0	-4.3	0.0	0.0	0.0	26.9
기타법인	7.9	-4.8	3.1	0.0	0.1	4.4	0.3	-0.4	2.2	-11.6

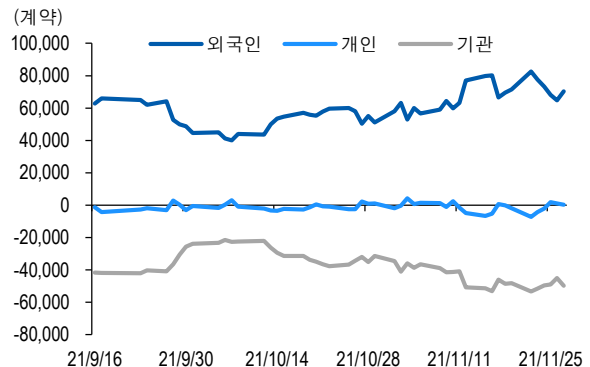
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 선물 누적 순매수 추이



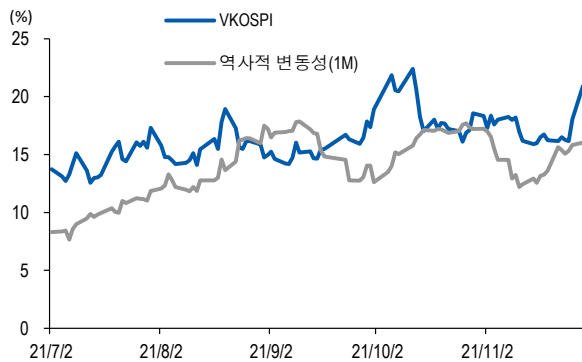
선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향					(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정
Call	974,964	246.9	888,237	18.3%	지수옵션 전체	2,472,906	697.7	2,433,947
Put	1,497,942	450.8	1,545,710	20.6%	PCR(금액기준)	1.83	VKOSPI	20.92%(+2.88%p)

	행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성		행사가	증가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성
Call	392.5(K+3)	1.25	-0.64	84,473	15,917	5,638	18.0	Put	387.5(K+1)	8.23	1.81	2,804	10,551	-123	18.2
	390.0(K+2)	1.92	-0.80	98,128	16,362	3,608	18.7		385.0(K+0)	6.69	1.50	8,809	19,814	-133	18.5
	387.5(K+1)	2.70	-1.06	43,957	8,193	3,155	19.0		382.5(K-1)	5.49	1.33	15,519	14,169	150	19.3
	385.0(K+0)	3.86	-1.18	22,092	7,260	2,767	20.0		380.0(K-2)	4.44	1.14	37,800	34,586	-1,720	20.0
	382.5(K-1)	5.03	-1.49	7,834	2,468	1,678	20.4		377.5(K-3)	3.65	1.02	34,732	14,700	-765	21.0

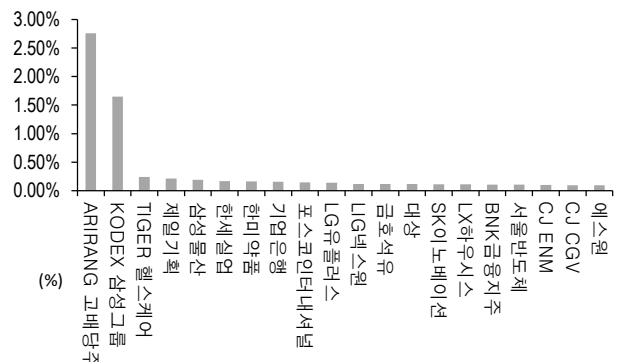
자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

역사적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 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	4,321,488	3,388.4	4,992,853	-126,730	44,078	-182,107	149,244	29.7	-102.0	83.9

종목명	선물현재가 (원)	등락률 (%)	선물거래대금 (십억원)	선현배율 (%)	미결제수량 (계약)	미결제증감 (계약)	평균괴리율 (%)	외국인 순매수	개인 순매수	기관 순매수	금융투자 순매수	연기금등 순매수
삼성전자	72,500	0.00	1,042.9	86.6	1,215,264	-35,108	0.03%	2,026	-31,562	30,265	766	29,824
엔씨소프트	690,000	-0.86	160.2	79.3	9,690	-175	-0.03%	-641	-32	673	706	805
삼성 SDI	710,000	-0.42	99.3	70.5	28,756	-442	0.07%	454	-111	-313	53	-366
LG 이노텍	292,500	-0.68	69.3	65.9	8,877	419	0.00%	938	266	-1,204	-854	-347
SK 하이닉스	117,000	1.30	333.6	65.2	131,473	20,606	-0.03%	5,256	-1,162	-4,093	-18,785	-3,386
삼성전기	170,500	0.00	59.3	57.4	35,512	-2,891	0.00%	1,463	-587	74	-1,752	3,062
LG 화학	713,000	-1.25	67.4	55.2	8,518	-440	-0.01%	3	111	-114	241	-355
GS 건설	37,550	-2.34	7.4	49.4	31,521	-1,559	-0.02%	1,654	-2,450	796	1,921	-1,125
대한항공	26,650	-1.48	54.9	48.1	57,556	-16,630	0.00%	398	-8,442	8,044	4,547	-6,966
NAVER	386,500	-0.77	83.3	47.1	44,426	-2,009	-0.13%	879	-3,446	3,367	2,419	948

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터